

Fecha de Publicación: 7 de abril de 2020

Fecha de Información: 03 de abril de 2020 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2227.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	341.5	227.8	82.5	249.5	59.1	5.8	86.2
15-35	660.7	706.2	483.3	187.3	105.9	356.4	117.0
36-60	17.2	14.9	0.0	0.0	14.9	17.2	0.0
61-90	32.5	49.0	20.0	11.4	19.0	11.1	10.0
91-180	128.5	76.0	60.0	73.1	16.0	55.4	0.0
>180	73.7	123.1	110.0	59.5	3.1	4.2	10.0
Total	1254.1	1196.9	755.8	580.8	218.0	450.2	223.2

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.9 %	1.3 %	1.5 %	1.3 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.6 %	1.7 %	2.1 %
61-90	2.1 %	2.8 %	2.0 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.4 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
Total	1.4 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	103	7518	7496	5	101	5729	6102	64	122	5675	5698
Intragruppo y off-shore***	0	1	3609	3932	0	0	3291	3073	0	0	2872	1890
Otros	103	30	1449	1147	101	5	883	728	122	64	997	1946
Total	133	133	12575	12575	107	107	9902	9902	187	187	9543	9534

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.