

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2020

Fecha de Información: 07 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\$2444.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97.1	352.8	266.1	14.0	9.8	6.2	76.8
15-35	872.0	1076.2	570.7	340.8	33.5	59.1	472.0
36-60	117.3	34.7	11.0	1.0	9.7	102.3	14.0
61-90	283.9	38.9	0.0	269.6	28.9	4.3	10.0
91-180	40.1	46.6	20.0	0.0	16.6	30.1	10.0
>180	61.6	46.6	0.0	10.0	6.6	11.6	40.0
Total	1472.0	1595.7	867.8	635.4	105.2	213.7	622.8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	1.5 %	1.0 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.2 %	1.4 %
36-60	1.7 %	2.4 %	1.4 %	1.5 %
61-90	2.1 %	2.8 %	1.9 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.9 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.7 %	3.0 %	2.4 %	2.6 %
Total	1.5 %	1.8 %	1.4 %	1.5 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	6 al 10 de abril				13 al 17 de abril				20 al 24 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	102	5902	6462	66	127	6005	6013	31	90	3953	4172
Intragruppo y off-shore***	0	0	3646	3242	0	0	3030	2067	0	0	1529	823
Otros	102	5	886	730	127	66	1006	1950	90	31	1190	1676
Total	107	107	10434	10434	193	193	10040	10031	121	121	6671	6671

* 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.

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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.