

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2020

Fecha de Información: 08 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\$1115.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	66.3	198.6	170.0	21.0	23.6	40.3	5.0
15-35	295.2	343.2	191.3	158.6	27.9	12.6	124.0
36-60	12.8	47.5	30.0	0.0	7.5	2.8	10.0
61-90	25.8	23.8	0.0	10.0	23.8	15.8	0.0
91-180	14.3	134.1	80.0	0.0	44.1	4.3	10.0
>180	90.3	42.8	0.0	57.0	12.8	3.3	30.0
Total	504.7	789.8	471.3	246.6	139.6	79.1	179.0

* 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	1.7 %		1.9 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.7 %		2.1 %	1.6 %	1.8 %
36-60	1.7 %		2.1 %	1.2 %	1.9 %
61-90	-		3.2 %	2.0 %	2.6 %
91-180	2.5 %		2.8 %	2.0 %	2.7 %
>180	2.8 %		2.9 %	2.5 %	2.8 %
Total	1.9 %		2.3 %	1.7 %	2.0 %

*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	6465	67	130	6062	6167	31	92	3980	4218
Intragrupo y off-shore***	0	0	3646	3242	0	0	3170	2088	0	0	1559	823
Otros	102	5	889	730	130	67	1014	1981	92	31	1201	1699
Total	107	107	10437	10437	196	196	10246	10236	123	123	6740	6740

* 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: $((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.