

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2020

Fecha de Información: 15 de abril de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2514.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	327.6	665.6	406.8	156.7	202.7	114.8	56.2
15-35	421.6	596.3	431.0	87.7	33.0	201.6	132.3
36-60	160.5	55.1	0.0	0.0	10.1	115.5	45.0
61-90	202.4	82.7	0.0	0.0	82.7	202.4	0.0
91-180	57.1	72.1	10.0	0.0	12.1	7.1	50.0
>180	132.7	128.7	14.0	20.0	9.7	7.7	105.0
Total	1301.9	1600.5	861.8	264.4	350.2	649.1	388.5

* 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	
3-14	2.4 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
36-60	2.7 %	3.1 %	2.1 %	2.3 %
61-90	-	3.0 %	2.4 %	2.5 %
91-180	3.2 %	2.9 %	2.4 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.2 %	2.4 %	2.8 %
Total	2.7 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %

*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	13 al 17 de abril				20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	145	6630	7392	34	94	4306	4509	24	92	4151	4584
Intragrupo y off-shore***	0	0	4040	2480	0	0	1735	906	0	0	2301	876
Otros	145	67	1197	1985	94	34	1254	1880	92	24	659	1651
Total	211	211	11867	11857	128	128	7295	7295	116	116	7111	7111

* 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.