

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2020

Fecha de Información: 16 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\$1851.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	202.2	381.0	266.5	122.0	47.8	13.5	66.7
15-35	448.7	747.1	502.5	37.0	38.6	205.7	206.0
36-60	9.3	3.1	0.0	0.0	3.1	9.3	0.0
61-90	105.5	87.1	60.0	30.0	12.1	60.5	15.0
91-180	34.2	37.4	20.0	30.0	17.4	4.2	0.0
>180	77.7	5.7	1.0	70.0	4.7	7.7	0.0
Total	877.6	1261.5	850.0	289.0	123.8	300.9	287.7

* 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	2.8 %	2.4 %	1.2 %	2.2 %
15-35	3.0 %	2.9 %	2.7 %	2.9 %
36-60	-	3.2 %	2.3 %	2.5 %
61-90	2.9 %	3.0 %	2.7 %	2.7 %
91-180	-	3.0 %	2.7 %	2.8 %
>180	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
Total	3.0 %	2.8 %	2.4 %	2.7 %

*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	6693	7512	34	103	4415	4784	24	92	4181	4661
Intragruppo y off-shore***	0	0	4142	2525	0	0	1983	981	0	0	2317	878
Otros	145	67	1198	1987	103	34	1256	1890	92	24	695	1654
Total	212	212	12034	12024	137	137	7654	7654	117	117	7193	7193

* 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 intragruppo.