

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2020

Fecha de Información: 20 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\$1909.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	274.6	264.6	180.0	221.0	53.1	22.1	31.5
15-35	754.8	730.4	513.5	47.5	7.0	497.4	209.9
36-60	8.0	12.9	0.0	0.0	11.9	7.0	1.0
61-90	4.2	3.9	0.0	0.0	3.9	4.2	0.0
91-180	22.0	35.7	0.0	0.0	19.7	6.0	16.0
>180	25.3	31.1	20.0	25.0	11.1	0.3	0.0
Total	1089.0	1078.6	713.5	293.5	106.7	537.1	258.4

* 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	3.2 %		3.5 %	2.6 %	2.9 %
15-35	3.2 %		3.3 %	3.0 %	3.1 %
36-60	3.1 %		3.6 %	2.7 %	3.3 %
61-90	-		3.5 %	2.7 %	3.1 %
91-180	2.9 %		3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	-		2.9 %	2.1 %	2.9 %
Total	3.2 %		3.3 %	2.9 %	3.1 %

*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	20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	105	4820	5363	28	93	4269	4797	20	98	4097	4004
Intragrupo y off-shore***	0	0	2383	1226	0	0	2376	918	0	0	2270	1307
Otros	105	35	1305	1920	93	28	762	1692	97	20	599	1656
Total	140	140	8509	8509	121	121	7407	7407	117	118	6967	6967

* 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.