

Fecha de Publicación: 23 de abril de 2020

Fecha de Información: 21 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\$1658.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	240.5	296.0	130.2	112.0	51.9	14.7	113.8
15-35	467.1	517.7	391.2	129.7	2.1	213.0	124.4
36-60	7.7	31.1	0.0	0.0	31.1	7.7	0.0
61-90	80.5	28.2	0.0	0.0	28.2	80.5	0.0
91-180	4.8	89.7	70.0	0.0	19.7	4.8	0.0
>180	106.1	37.0	20.0	10.0	7.0	86.1	10.0
Total	906.7	999.7	611.4	251.7	140.1	406.8	248.2

* 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 %	3.5 %	2.7 %	3.0 %
15-35	3.2 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
36-60	-	3.5 %	2.5 %	3.3 %
61-90	-	3.1 %	2.7 %	2.8 %
91-180	-	3.0 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.8 %	2.9 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.0 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %

*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	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**	34	108	4972	5434	29	92	4353	5019	20	97	4136	4056
Intragruppo y off-shore***	0	0	2408	1338	0	0	2474	918	0	0	2285	1307
Otros	108	34	1310	1920	92	29	814	1703	97	20	599	1658
Total	142	142	8691	8691	121	121	7640	7640	117	117	7020	7020

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