

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2020

Fecha de Información: 22 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\$2354.7 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	571.2	198.7	48.6	375.6	13.6	59.1	136.5
15-35	445.7	814.6	557.7	107.8	42.2	123.2	214.7
36-60	53.5	75.0	35.0	0.0	20.0	33.5	20.0
61-90	31.7	74.7	0.0	0.0	74.7	31.7	0.0
91-180	32.4	258.8	190.0	0.0	68.8	32.4	0.0
>180	119.7	59.9	0.0	1.4	49.9	108.3	10.0
Total	1254.2	1481.7	831.3	484.8	269.2	388.2	381.2

* 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	2.6 %	2.9 %	2.7 %	2.7 %
15-35	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
36-60	3.0 %	3.5 %	2.7 %	3.2 %
61-90	-	3.2 %	2.7 %	3.0 %
91-180	-	3.3 %	2.8 %	3.2 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.7 %	2.7 %
Total	3.0 %	3.2 %	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**	37	114	5372	5520	29	90	4469	5090	20	96	4219	4143
Intragruppo y off-shore***	0	0	2417	1661	0	0	2514	958	0	0	2301	1319
Otros	114	37	1311	1918	90	29	825	1759	96	20	601	1659
Total	151	151	9100	9100	119	119	7807	7807	116	116	7121	7121

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