

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2067.7 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	345.9	232.4	137.5	166.5	17.9	102.4	77.0
15-35	565.9	850.3	499.4	86.5	8.9	137.4	342.0
36-60	5.1	1.9	0.0	0.0	1.9	5.1	0.0
61-90	160.1	113.2	0.0	20.0	3.2	30.1	110.0
91-180	155.5	71.6	10.0	120.0	41.6	15.5	20.0
>180	102.5	42.2	10.0	40.0	2.2	32.5	30.0
Total	1335.1	1311.6	656.9	433.0	75.7	323.1	579.0

* 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 %	3.2 %	3.7 %	3.5 %
15-35	3.2 %	3.2 %	3.0 %	3.2 %
36-60	-	3.0 %	2.5 %	2.6 %
61-90	3.0 %	3.2 %	2.6 %	2.9 %
91-180	2.9 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
Total	3.1 %	3.2 %	3.1 %	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**	37	112	5595	5615	30	89	5184	5369	21	96	4481	4462
Intragrupo y off-shore***	0	0	2468	1854	0	0	2641	1497	0	0	2498	1320
Otros	112	37	1322	1916	89	30	836	1795	95	21	638	1835
Total	148	148	9385	9385	119	119	8661	8661	117	117	7617	7617

* 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 intragrupo.