

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2020

Fecha de Información: 28 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\$3322.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	746.5	421.8	225.0	523.1	82.3	109.0	114.5
15-35	710.8	1123.6	927.7	424.8	80.2	170.3	115.7
36-60	129.2	236.5	211.5	102.0	5.0	7.2	20.0
61-90	37.0	40.4	0.0	0.0	5.4	2.0	35.0
91-180	54.2	47.4	13.8	20.0	23.6	24.2	10.0
>180	33.2	37.0	21.6	20.0	15.4	13.2	0.0
Total	1710.9	1906.7	1399.5	1089.9	212.0	325.9	295.1

* 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	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
15-35	3.4 %	3.4 %	3.1 %	3.3 %
36-60	3.1 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
61-90	2.9 %	1.9 %	2.2 %	2.8 %
91-180	2.8 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
>180	-	2.7 %	1.5 %	2.2 %
Total	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %

* 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	27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	93	5992	5912	25	96	4763	4797	24	90	4333	4763
Intragruppo y off-shore***	0	0	2825	2245	0	0	2699	1454	0	0	2807	1018
Otros	93	28	1131	1791	95	25	691	1902	90	24	548	1907
Total	120	120	9948	9948	120	121	8153	8153	115	115	7688	7688

* 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.