

Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2020

Fecha de Información: 30 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\$1701.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	320.9	249.5	124.0	174.1	53.2	74.6	72.3
15-35	583.9	543.8	337.8	115.9	56.4	318.5	149.5
36-60	27.1	7.0	0.0	0.0	7.0	27.1	0.0
61-90	18.7	54.1	10.0	0.0	34.1	8.7	10.0
91-180	61.6	34.2	0.0	4.5	18.1	41.0	16.1
>180	34.3	34.0	5.0	10.0	9.0	4.3	20.0
Total	1046.5	922.4	476.8	304.4	177.7	474.2	267.9

* 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	
3-14	3.4 %	3.6 %	3.1 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.7 %	3.1 %	3.4 %
36-60	-	3.8 %	3.0 %	3.1 %
61-90	3.2 %	3.3 %	2.8 %	3.2 %
91-180	2.9 %	3.3 %	2.8 %	2.9 %
>180	2.8 %	3.3 %	2.5 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.6 %	3.1 %	3.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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**	21	93	6112	5940	25	99	5239	4967	24	94	4552	5064
Intragrupo y off-shore***	0	0	2840	2354	0	0	2748	1739	0	0	2909	1064
Otros	93	21	1134	1791	99	25	708	1989	94	24	680	2012
Total	115	115	10086	10086	124	125	8695	8695	118	118	8140	8140

* 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.