Fecha de Publicación: 2 de abril de 2020

Fecha de Información: 31 de marzo 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$2095.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.[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	381.0	455.9	101.0	171.7	151.4	5.8	203.5
15-35	817.1	683.2	323.0	114.5	30.2	372.6	330.0
36-60	118.4	40.7	0.0	0.0	40.7	118.4	0.0
61-90	1.3	5.9	0.0	0.0	5.9	1.3	0.0
91-180	2.2	91.3	60.0	0.0	31.3	2.2	0.0
>180	26.2	25.8	0.0	0.0	5.8	6.2	20.0
Total	**1346.2**	**1302.8**	**484.0**	**286.2**	**265.3**	**506.6**	**553.5**

* 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	2.7 %	2.9 %	2.8 %	2.8 %
15-35	2.6 %	2.9 %	2.4 %	2.6 %
36-60	-	3.3 %	2.5 %	2.7 %
61-90	-	4.0 %	2.6 %	3.7 %
91-180	-	2.9 %	3.1 %	2.9 %
>180	2.7 %	3.2 %	1.5 %	2.6 %
Total	2.6 %	2.9 %	2.5 %	2.7 %

*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	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	101	6981	7345	5	101	5050	5424	63	119	5359	5168
Intragrupo y off-shore***	0	1	3528	3466	0	0	3112	2627	0	0	2602	1833
Otros	101	30	1448	1147	101	5	601	711	119	63	966	1917
Total	**132**	**132**	**11957**	**11957**	**106**	**106**	**8762**	**8762**	**182**	**182**	**8927**	**8918**

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.