Fecha de Publicación: 8 de abril de 2020

Fecha de Información: 06 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$3133.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.[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	492.4	402.2	267.3	361.5	7.9	3.9	127.0
15-35	954.5	808.2	547.8	414.8	12.4	291.7	248.0
36-60	88.1	186.0	170.0	61.0	16.0	27.1	0.0
61-90	1.1	81.4	65.0	0.0	16.4	1.1	0.0
91-180	106.7	225.1	100.0	10.0	30.1	1.7	95.0
>180	111.5	146.5	100.0	102.0	46.5	9.5	0.0
Total	**1754.3**	**1849.4**	**1250.1**	**949.3**	**129.3**	**335.0**	**470.0**

* 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	1.8 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.8 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	2.5 %	1.7 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.7 %	2.3 %	2.5 %
>180	-	2.9 %	2.4 %	2.8 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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	6 al 10 de abril				13 al 17 de abril				20 al 24 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	102	5893	6269	66	126	5917	5874	31	90	3858	4079
Intragrupo y off-shore***	0	0	3456	3237	0	0	2974	2058	0	0	1509	795
Otros	102	5	885	728	126	66	998	1946	90	31	1182	1675
Total	**107**	**107**	**10234**	**10234**	**192**	**192**	**9889**	**9879**	**121**	**121**	**6549**	**6549**

* 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.