Fecha de Publicación: 16 de abril de 2020

Fecha de Información: 14 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$1396.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.[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	220.4	391.6	303.0	110.0	39.6	61.4	49.0
15-35	297.0	474.8	262.2	30.5	27.6	81.5	185.0
36-60	14.8	52.1	9.0	0.0	38.1	9.8	5.0
61-90	0.8	62.0	0.0	0.0	62.0	0.8	0.0
91-180	16.0	43.3	0.0	0.0	38.3	11.0	5.0
>180	61.1	67.2	5.0	0.0	2.2	1.1	60.0
Total	**610.0**	**1090.9**	**579.2**	**140.5**	**207.7**	**165.5**	**304.0**

* 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	2.3 %	2.4 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.4 %	1.6 %	2.2 %
36-60	2.6 %	3.1 %	2.1 %	2.9 %
61-90	-	22.8 %	2.0 %	22.6 %
91-180	2.7 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %
Total	2.4 %	5.0 %	1.8 %	3.4 %

*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	13 al 17 de abril				20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	144	6467	6918	33	94	4181	4353	24	92	4097	4537
Intragrupo y off-shore***	0	0	3765	2345	0	0	1604	885	0	0	2301	875
Otros	144	67	1026	1985	94	33	1251	1797	92	24	628	1614
Total	**211**	**211**	**11258**	**11249**	**127**	**127**	**7036**	**7036**	**115**	**115**	**7026**	**7026**

* 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.