Fecha de Publicación: 21 de abril de 2020

Fecha de Información: 17 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$1691.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.[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	223.1	462.1	288.5	63.5	64.7	50.7	108.9
15-35	498.1	463.4	161.0	90.0	49.4	155.1	253.0
36-60	64.0	6.5	0.0	0.0	6.5	64.0	0.0
61-90	84.6	52.6	40.0	42.0	12.6	42.6	0.0
91-180	31.2	81.1	65.8	0.0	15.4	31.2	0.0
>180	79.2	72.5	5.0	10.0	2.5	4.2	65.0
Total	**980.3**	**1138.3**	**560.3**	**205.5**	**151.1**	**347.8**	**426.9**

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.9 %	3.3 %	2.7 %	3.0 %
15-35	3.2 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
36-60	-	4.0 %	2.5 %	2.6 %
61-90	-	3.3 %	2.6 %	2.9 %
91-180	-	3.2 %	2.6 %	2.8 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.4 %	2.8 %
Total	3.0 %	3.3 %	2.7 %	3.0 %

*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	145	6693	7512	34	104	4601	5201	24	93	4218	4705
Intragrupo y off-shore***	0	0	4142	2525	0	0	2253	1045	0	0	2336	878
Otros	145	67	1198	1987	104	34	1305	1913	92	24	710	1681
Total	**212**	**212**	**12034**	**12024**	**138**	**138**	**8159**	**8159**	**117**	**117**	**7264**	**7264**

* 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.