Fecha de Publicación: 29 de abril de 2020

Fecha de Información: 27 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$2501.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.[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	459.0	615.9	199.8	398.5	361.4	5.8	54.7
15-35	495.5	707.7	502.0	30.8	6.5	265.5	199.2
36-60	78.9	31.8	0.0	21.8	29.8	55.1	2.0
61-90	236.3	2.3	0.0	67.0	2.3	169.3	0.0
91-180	51.6	35.9	20.0	20.0	10.9	26.6	5.0
>180	37.2	40.1	4.0	0.0	6.1	7.2	30.0
Total	**1358.6**	**1433.7**	**725.8**	**538.1**	**417.0**	**529.6**	**290.9**

* 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	3.4 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
15-35	3.3 %	3.3 %	2.9 %	3.2 %
36-60	3.0 %	3.2 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	3.2 %	2.8 %	2.8 %
91-180	2.9 %	3.4 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.7 %	3.9 %	2.1 %	2.9 %
Total	3.3 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %

*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	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**	30	90	5581	5811	22	96	4524	4613	18	90	4216	4463
Intragrupo y off-shore***	0	0	2764	1874	0	0	2575	1338	0	0	2608	982
Otros	90	30	1134	1794	95	22	689	1837	90	18	467	1845
Total	**120**	**120**	**9478**	**9478**	**117**	**118**	**7788**	**7788**	**109**	**109**	**7291**	**7291**

* 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.