Fecha de Publicación: 4 de mayo de 2020

Fecha de Información: 29 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$2625.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.[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	477.6	229.1	41.6	249.8	77.2	117.6	110.2
15-35	870.8	692.5	238.8	337.6	179.8	259.1	274.0
36-60	5.0	24.7	1.2	0.0	23.5	5.0	0.0
61-90	150.3	150.0	1.0	26.7	29.0	3.6	120.0
91-180	312.0	421.1	125.0	0.0	32.1	48.0	264.0
>180	16.3	49.4	30.0	10.0	14.4	1.3	5.0
Total	**1832.0**	**1566.8**	**437.6**	**624.1**	**356.0**	**434.7**	**773.2**

* 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 %	3.8 %	3.2 %	3.4 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	3.8 %	2.9 %	3.7 %
61-90	3.1 %	3.6 %	2.6 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.1 %	2.7 %	3.0 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.2 %	2.9 %
Total	3.2 %	3.5 %	3.2 %	3.2 %

*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**	26	92	6106	5936	26	98	5012	4848	24	93	4463	4925
Intragrupo y off-shore***	0	0	2840	2351	0	0	2702	1576	0	0	2831	1056
Otros	92	26	1130	1789	98	26	697	1987	93	24	628	1942
Total	**118**	**118**	**10076**	**10076**	**124**	**125**	**8411**	**8411**	**117**	**117**	**7922**	**7922**

* 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.