

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2020

Fecha de Información: 04 de mayo 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\$2199.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	453.5	438.9	149.0	140.0	115.0	138.6	174.9
15-35	951.9	585.7	322.6	28.7	16.1	676.1	247.0
36-60	21.1	13.1	10.0	5.0	3.1	16.1	0.0
61-90	9.6	20.8	0.0	0.0	20.8	9.6	0.0
91-180	106.1	90.4	0.0	0.0	10.4	26.1	80.0
>180	8.5	9.9	0.0	0.0	1.9	0.5	8.0
Total	1550.7	1158.9	481.6	173.7	167.4	867.1	509.9

* 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	3.7 %	3.2 %	3.1 %	3.3 %
15-35	3.8 %	3.8 %	3.5 %	3.7 %
36-60	-	3.8 %	3.2 %	3.4 %
61-90	-	3.4 %	2.9 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.0 %	2.8 %	3.0 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.3 %	2.8 %
Total	3.7 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %

* 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	4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	101	5503	5140	25	94	4683	5229	50	347	4622	5386
Intragrupo y off-shore***	0	0	2794	1879	0	0	2965	1064	0	0	3108	956
Otros	101	29	712	1990	94	25	789	2144	347	50	837	2226
Total	129	130	9009	9009	118	118	8437	8437	397	397	8567	8567

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.