

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2020

Fecha de Información: 05 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\$2323.3 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	603.2	353.7	71.4	325.1	86.3	82.1	196.0
15-35	729.4	574.8	248.1	230.8	27.7	199.6	299.0
36-60	64.4	69.0	60.0	63.1	9.0	1.2	0.0
61-90	9.2	64.5	30.0	0.0	34.5	9.2	0.0
91-180	50.7	269.8	220.3	0.0	19.6	20.7	30.0
>180	19.7	46.9	0.0	10.0	39.9	2.7	7.0
Total	1476.5	1378.7	629.8	629.0	217.0	315.5	532.0

* 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	3.5 %	3.7 %	2.5 %	3.0 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.3 %	3.5 %
36-60	-	3.4 %	3.2 %	3.3 %
61-90	-	3.3 %	2.3 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.6 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.5 %	2.8 %	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	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**	36	114	5622	5174	25	93	5110	5478	45	348	4763	5489
Intragrupo y off-shore***	0	0	2845	1998	0	0	2985	1263	0	0	3108	975
Otros	113	36	694	1990	93	25	871	2226	348	45	841	2248
Total	149	149	9162	9162	119	119	8966	8966	393	393	8712	8712

* 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.