

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2020

Fecha de Información: 06 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\$2410.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	572.2	198.8	70.1	472.5	95.4	66.4	33.3
15-35	631.9	739.6	582.0	320.4	14.7	168.5	143.0
36-60	53.9	1.7	0.6	50.0	1.1	3.9	0.0
61-90	2.6	46.7	40.0	0.0	6.7	2.6	0.0
91-180	34.0	242.7	240.0	0.0	2.7	34.0	0.0
>180	27.8	45.3	20.0	10.0	15.3	7.8	10.0
Total	1322.4	1274.9	952.7	852.9	135.9	283.1	186.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	3.7 %	2.8 %	3.1 %
15-35	3.7 %	3.6 %	3.4 %	3.6 %
36-60	-	3.6 %	2.8 %	2.9 %
61-90	-	3.4 %	1.6 %	2.9 %
91-180	-	3.1 %	2.8 %	3.0 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.5 %	2.7 %
Total	3.6 %	3.6 %	3.1 %	3.4 %

* 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**	37	113	5730	5191	26	92	5517	5657	45	348	4819	5495
Intragruppo y off-shore***	0	0	2860	2103	0	0	3040	1581	0	0	3108	1051
Otros	112	37	694	1990	92	26	966	2285	348	45	847	2228
Total	149	150	9284	9284	118	118	9523	9523	394	394	8774	8774

* 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 intragruppo.