

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2020

Fecha de Información: 07 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\$2695.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	624.2	331.8	175.0	388.9	15.3	93.9	141.5
15-35	916.9	751.2	486.1	425.2	43.9	270.5	221.2
36-60	20.8	73.7	63.0	19.0	10.7	1.8	0.0
61-90	7.3	52.2	30.0	0.0	17.2	2.3	5.0
91-180	25.4	232.4	220.0	0.0	12.4	25.4	0.0
>180	11.6	15.2	0.0	10.0	15.2	1.6	0.0
Total	1606.2	1456.6	974.1	843.1	114.8	395.5	367.7

* 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 %	3.5 %	2.9 %	3.1 %
15-35	3.5 %	3.4 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-	3.9 %	2.9 %	3.8 %
61-90	3.3 %	3.3 %	2.7 %	3.3 %
91-180	-	3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	-	2.8 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.5 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %

* 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	114	5922	5316	23	91	5749	5822	45	346	5065	5549
Intragrupo y off-shore***	0	0	2890	2197	0	0	3160	1773	0	0	3148	1172
Otros	113	37	688	1987	91	23	984	2298	346	45	846	2339
Total	151	151	9500	9500	114	114	9893	9893	392	392	9060	9060

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