

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2020

Fecha de Información: 08 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\$1447.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	385.3	371.7	131.5	82.5	52.7	115.3	187.5
15-35	509.4	336.7	116.5	155.5	87.9	221.6	132.3
36-60	22.5	16.6	0.0	0.0	16.6	22.5	0.0
61-90	5.7	21.0	0.0	0.0	21.0	5.7	0.0
91-180	3.8	28.6	0.0	0.0	28.6	3.8	0.0
>180	29.0	42.2	10.0	0.0	27.2	24.0	5.0
Total	955.8	816.8	258.0	238.0	234.0	393.0	324.8

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.3 %	3.7 %	3.3 %	3.4 %
15-35	3.4 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.6 %
61-90	-	3.7 %	2.8 %	3.5 %
91-180	-	3.4 %	2.4 %	3.3 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.3 %	3.5 %	3.3 %	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**	39	113	5926	5308	23	98	6033	6134	45	351	5166	5601
Intragruo y off-shore***	0	0	2890	2197	0	0	3285	1838	0	0	3155	1190
Otros	112	39	681	1991	98	23	1010	2356	351	45	865	2395
Total	152	152	9497	9497	120	120	10328	10328	396	396	9186	9186

* 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 intragruo.