

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2020

Fecha de Información: 11 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\$1733.4 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	357.7	419.3	79.7	148.0	232.1	102.2	107.5
15-35	413.2	515.0	222.4	69.7	85.1	136.0	207.5
36-60	61.0	33.8	0.0	31.7	13.8	9.3	20.0
61-90	150.4	20.5	0.0	0.0	20.5	150.4	0.0
91-180	1.7	23.3	0.0	0.0	23.3	1.7	0.0
>180	30.9	41.7	0.0	0.0	41.7	30.9	0.0
Total	1014.9	1053.5	302.1	249.4	416.4	430.5	335.0

* 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	
3-14	3.4 %	3.3 %	3.3 %	3.3 %
15-35	3.4 %	3.6 %	2.9 %	3.3 %
36-60	3.2 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
61-90	-	3.5 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.2 %	3.1 %
>180	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
Total	3.4 %	3.4 %	3.1 %	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	11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	97	6315	6516	46	348	5234	5633	22	111	2494	3202
Intragrupo y off-shore***	0	0	3364	1961	0	0	3155	1215	0	0	1874	538
Otros	97	24	1205	2407	348	46	897	2439	111	22	545	1174
Total	121	121	10884	10884	394	394	9287	9287	133	133	4914	4914

* 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 intragrupo.