

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2020

Fecha de Información: 12 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\$2249.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	638.0	219.6	52.0	432.0	19.6	58.0	148.0
15-35	638.4	879.4	604.5	113.3	32.4	282.7	242.5
36-60	55.5	29.7	0.0	0.0	19.7	45.5	10.0
61-90	1.4	11.9	0.0	0.0	11.9	1.4	0.0
91-180	14.8	83.4	13.2	0.0	60.2	4.8	10.0
>180	58.0	37.3	27.5	10.0	2.8	41.0	7.0
Total	1406.1	1261.3	697.2	555.3	146.6	433.4	417.5

* 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	2.9 %	3.5 %	2.2 %	2.5 %
15-35	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.4 %
36-60	3.2 %	3.4 %	2.9 %	3.1 %
61-90	-	3.5 %	2.8 %	3.5 %
91-180	3.1 %	3.0 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.7 %	2.7 %
Total	3.2 %	3.4 %	2.7 %	3.0 %

*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**	27	97	6917	6687	96	346	5262	5663	21	113	2513	3218
Intragrupo y off-shore***	0	0	3386	2371	0	0	3175	1237	0	0	1884	548
Otros	97	27	1205	2451	346	96	907	2445	113	21	551	1183
Total	124	124	11508	11508	442	442	9345	9345	133	133	4948	4948

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