

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2020

Fecha de Información: 13 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\$1900.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	341.9	138.0	17.0	147.2	42.1	115.8	78.9
15-35	779.9	734.6	363.0	20.0	79.1	467.4	292.5
36-60	97.8	7.7	0.4	0.0	7.3	97.8	0.0
61-90	2.0	14.1	0.0	0.0	14.1	2.0	0.0
91-180	7.8	95.2	0.3	0.0	94.9	7.8	0.0
>180	25.3	27.9	0.0	5.0	27.9	20.3	0.0
Total	1254.7	1017.5	380.7	172.2	265.4	711.1	371.4

* 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	3.4 %	3.5 %	2.4 %	2.8 %
15-35	3.5 %	3.5 %	3.1 %	3.3 %
36-60	-	3.5 %	3.0 %	3.0 %
61-90	-	3.3 %	1.6 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.8 %	3.1 %
>180	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
Total	3.5 %	3.4 %	2.9 %	3.2 %

*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**	29	100	7116	6757	96	344	5328	5694	21	112	2582	3265
Intragruppo y off-shore***	0	0	3393	2476	0	0	3185	1279	0	0	1899	548
Otros	100	29	1208	2485	344	96	914	2454	112	21	579	1246
Total	129	129	11717	11717	440	440	9427	9427	133	133	5059	5059

* 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 intragruppo.