

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2020

Fecha de Información: 14 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\$1639.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	290.7	255.8	158.0	96.5	15.4	111.8	82.4
15-35	439.2	534.1	350.3	97.2	34.3	192.5	149.5
36-60	3.5	51.1	40.0	0.0	11.1	3.5	0.0
61-90	12.2	7.1	0.0	0.0	7.1	12.2	0.0
91-180	50.6	92.6	35.0	0.0	24.6	17.6	33.0
>180	50.8	116.6	0.0	37.3	116.6	13.5	0.0
Total	847.0	1057.2	583.3	230.9	209.0	351.2	264.9

* 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	3.3 %	3.7 %	1.8 %	2.4 %
15-35	3.5 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.4 %	3.0 %	3.4 %
61-90	-	3.4 %	3.0 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.1 %	2.7 %	3.0 %
>180	-	2.8 %	2.6 %	2.7 %
Total	3.4 %	3.3 %	2.7 %	3.1 %

* 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**	31	92	7172	6798	95	350	5518	5726	21	110	2627	3441
Intragrupo y off-shore***	0	0	3393	2493	0	0	3193	1353	0	0	2049	553
Otros	92	31	1208	2483	350	95	919	2551	110	21	582	1265
Total	123	123	11774	11774	445	445	9630	9630	131	131	5258	5258

* 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.