

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2020

Fecha de Información: 15 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\$1672.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	390.6	237.6	100.0	282.9	47.6	17.6	90.0
15-35	406.7	534.3	338.4	112.0	8.9	107.7	187.0
36-60	6.5	6.3	0.0	0.0	6.3	6.5	0.0
61-90	66.1	106.6	20.0	7.0	46.6	19.1	40.0
91-180	99.4	143.9	80.0	54.0	28.9	10.4	35.0
>180	10.3	16.6	10.0	0.0	6.6	10.3	0.0
Total	979.5	1045.2	548.4	455.9	144.8	171.6	352.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	4.0 %	2.8 %	3.1 %
15-35	3.4 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.7 %	2.4 %	3.1 %
61-90	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.1 %	3.0 %	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**	31	90	7172	6799	96	353	5895	5908	21	110	2637	3477
Intragruppo y off-shore***	0	0	3393	2493	0	0	3293	1636	0	0	2049	553
Otros	90	31	1209	2483	353	96	911	2555	110	21	619	1274
Total	121	121	11775	11775	449	449	10099	10099	131	131	5304	5304

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