

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2020

Fecha de Información: 18 de mayo de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1556.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	355.2	185.5	39.2	218.7	39.4	29.6	106.9
15-35	646.2	533.2	239.5	131.5	29.7	250.7	264.0
36-60	22.6	65.5	10.0	0.0	35.5	2.6	20.0
61-90	0.8	15.9	0.0	0.0	15.9	0.8	0.0
91-180	34.6	43.7	0.0	25.0	43.7	9.6	0.0
>180	24.5	19.3	0.0	21.2	19.3	3.3	0.0
Total	1084.0	863.2	288.7	396.4	183.6	296.7	390.9

* 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	
3-14	3.3 %	4.1 %	2.7 %	3.1 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	3.4 %	3.8 %	2.9 %	3.6 %
61-90	-	3.7 %	2.6 %	3.6 %
91-180	-	3.1 %	3.1 %	3.1 %
>180	-	2.9 %	2.5 %	2.7 %
Total	3.5 %	3.6 %	3.1 %	3.4 %

*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	18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	97	361	6218	6036	21	114	2674	3511	13	107	4495	4195
Intragrupo y off-shore***	0	0	3305	1842	0	0	2076	563	0	0	2478	1561
Otros	361	97	922	2568	114	21	624	1300	107	13	380	1597
Total	459	459	10446	10446	135	135	5374	5374	119	119	7353	7353

* 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.