

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2020

Fecha de Información: 20 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\$2233.3 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	561.2	197.1	17.0	385.0	15.4	11.5	164.7
15-35	895.2	816.6	398.4	187.9	84.5	373.5	333.8
36-60	35.3	52.0	0.0	0.0	22.0	5.3	30.0
61-90	10.6	44.9	0.0	0.0	44.9	10.6	0.0
91-180	32.9	50.0	0.0	19.1	44.0	7.9	6.0
>180	27.1	56.8	0.0	15.0	44.8	0.1	12.0
Total	1562.2	1217.5	415.4	606.9	255.7	408.9	546.4

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.0 %	4.4 %	2.9 %	3.0 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
36-60	3.4 %	3.9 %	3.3 %	3.6 %
61-90	-	3.4 %	3.4 %	3.4 %
91-180	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.4 %	3.6 %	3.3 %	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**	105	356	7165	6488	22	115	2833	3621	13	110	4594	4266
Intragrupo y off-shore***	0	0	3404	2463	0	0	2076	632	0	0	2478	1566
Otros	356	105	966	2583	115	22	639	1295	110	13	401	1641
Total	461	461	11535	11535	137	137	5548	5548	123	123	7473	7473

* 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.