

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2020

Fecha de Información: 21 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\$1901.3 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	333.4	185.2	60.0	202.5	30.5	36.1	94.8
15-35	686.0	646.5	361.2	123.5	35.9	313.1	249.4
36-60	68.3	23.1	0.0	0.0	23.1	68.3	0.0
61-90	16.0	132.0	0.7	0.0	131.2	16.0	0.0
91-180	40.8	82.0	4.3	10.0	47.7	0.8	30.0
>180	22.6	49.5	0.0	10.0	39.5	2.6	10.0
Total	1167.2	1118.3	426.3	346.0	307.9	437.0	384.2

* 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	3.4 %	2.3 %	2.0 %	2.4 %
15-35	3.4 %	3.2 %	3.3 %	3.3 %
36-60	-	3.8 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.3 %	3.1 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.6 %	3.0 %
Total	3.4 %	3.1 %	2.9 %	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	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**	104	357	7392	6596	23	117	2890	3660	13	111	4644	4300
Intragrupo y off-shore***	0	0	3440	2620	0	0	2085	673	0	0	2493	1572
Otros	357	104	968	2583	117	23	659	1300	111	13	406	1672
Total	461	461	11799	11799	139	139	5634	5634	124	124	7544	7544

* 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.