

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2020

Fecha de Información: 22 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\$2033.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	451.2	275.7	43.7	227.0	20.0	12.2	212.0
15-35	611.5	536.9	253.5	105.0	31.4	254.5	252.0
36-60	3.3	22.4	0.0	0.0	22.4	3.3	0.0
61-90	114.3	197.3	4.5	10.0	182.8	94.3	10.0
91-180	170.0	168.4	20.0	35.0	58.4	45.0	90.0
>180	31.8	24.8	0.0	18.8	14.8	3.0	10.0
Total	1382.0	1225.5	321.7	395.8	329.8	412.2	574.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	3.0 %	2.4 %	2.9 %
15-35	3.5 %	3.4 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.7 %	2.9 %	3.6 %
61-90	3.3 %	3.2 %	3.2 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.0 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.4 %	3.3 %	2.9 %	3.2 %

*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	7393	6599	21	118	3252	3811	13	112	4734	4413
Intragrupo y off-shore***	0	0	3440	2620	0	0	2094	884	0	0	2528	1587
Otros	357	104	970	2584	118	21	661	1311	112	13	413	1674
Total	461	461	11802	11802	139	139	6007	6007	125	125	7675	7675

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