

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2020

Fecha de Información: 26 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\$2582.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	606.4	322.5	249.9	529.4	11.0	15.4	61.6
15-35	606.8	911.3	620.1	30.0	64.5	350.1	226.7
36-60	48.8	132.9	80.0	0.0	12.9	8.8	40.0
61-90	31.8	42.4	0.0	0.0	42.4	31.8	0.0
91-180	108.9	116.9	0.0	25.9	34.9	1.0	82.0
>180	26.7	63.9	15.0	0.0	22.4	0.2	26.5
Total	1429.5	1589.9	965.0	585.3	188.1	407.4	436.8

* 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	4.3 %	4.2 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	3.4 %	3.4 %	3.1 %	3.4 %
61-90	-	3.4 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.2 %	3.3 %	3.2 %	3.2 %
>180	2.8 %	2.9 %	2.4 %	2.9 %
Total	3.5 %	3.6 %	3.3 %	3.5 %

*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	25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio				8 al 12 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	116	3825	3858	14	113	4749	4633	48	102	4936	5162
Intragrupo y off-shore***	0	0	2095	1394	0	0	2735	1593	0	0	3215	1687
Otros	116	22	653	1320	113	14	418	1676	102	48	495	1796
Total	138	138	6573	6573	127	127	7902	7902	151	151	8646	8646

* 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.