

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2020

Fecha de Información: 27 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\$1687.6 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	356.7	284.0	65.0	143.8	88.0	82.0	131.0
15-35	658.8	492.9	235.0	148.3	63.9	316.6	194.0
36-60	3.8	14.3	0.4	0.0	13.9	3.8	0.0
61-90	35.4	76.0	0.0	0.0	56.0	15.4	20.0
91-180	42.0	70.9	10.0	10.0	40.9	12.0	20.0
>180	2.3	15.4	0.0	0.0	15.4	2.3	0.0
Total	1099.2	953.4	310.4	302.0	278.0	432.2	365.0

* 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 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
15-35	3.5 %	3.7 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	4.1 %	2.4 %	3.7 %
61-90	3.3 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
>180	-	3.0 %	2.4 %	2.9 %
Total	3.5 %	3.6 %	3.4 %	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**	27	119	3976	3917	15	113	4934	4837	51	102	5004	5236
Intragrupo y off-shore***	0	0	2128	1515	0	0	2767	1616	0	0	3215	1687
Otros	119	27	651	1322	113	15	497	1744	102	51	504	1799
Total	146	146	6754	6754	128	128	8198	8198	154	154	8723	8723

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