

Fecha de Publicación: 1 de junio de 2020

Fecha de Información: 28 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\$1822.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	394.2	237.8	81.1	238.0	20.0	19.5	136.7
15-35	435.8	538.0	305.5	103.8	104.9	204.4	127.6
36-60	2.2	18.4	0.0	0.0	18.4	2.2	0.0
61-90	40.6	185.2	30.0	0.0	125.2	10.6	30.0
91-180	75.8	142.0	40.0	0.0	62.0	35.8	40.0
>180	70.7	36.5	0.0	25.9	16.5	24.8	20.0
Total	1019.2	1157.9	456.6	367.7	347.0	297.2	354.3

* 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	3.3 %	3.7 %	2.8 %	3.2 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.3 %	3.5 %
36-60	-	3.8 %	2.8 %	3.7 %
61-90	3.2 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.3 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.3 %	3.5 %	3.1 %	3.3 %

* 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**	31	103	4130	3935	17	104	5111	4937	51	105	5066	5398
Intragrupo y off-shore***	0	0	2129	1661	0	0	2780	1708	0	0	3283	1687
Otros	103	31	657	1321	104	17	507	1753	105	51	547	1810
Total	134	134	6917	6917	122	122	8398	8398	156	156	8896	8896

* 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.