

Fecha de Publicación: 2 de junio de 2020

Fecha de Información: 29 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\$1833.6 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	450.4	364.5	110.5	203.5	19.5	12.4	234.5
15-35	569.6	438.7	202.3	174.0	96.9	256.1	139.5
36-60	21.9	77.0	0.0	20.0	77.0	1.9	0.0
61-90	12.3	88.5	0.0	0.0	78.5	2.3	10.0
91-180	54.5	56.3	0.0	8.7	35.3	24.8	21.0
>180	54.2	64.5	40.0	20.0	11.0	20.7	13.5
Total	1162.8	1089.4	352.8	426.2	318.1	318.1	418.5

* 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 %		3.5 %	2.5 %	3.1 %
15-35	3.4 %		3.6 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-		3.5 %	3.3 %	3.5 %
61-90	3.2 %		3.3 %	2.4 %	3.3 %
91-180	3.0 %		3.0 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.8 %		2.8 %	2.3 %	2.6 %
Total	3.4 %		3.4 %	3.0 %	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	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	101	4130	3937	16	113	5444	5183	51	105	5182	5508
Intragrupo y off-shore***	0	0	2129	1661	0	0	2891	1897	0	0	3283	1702
Otros	101	31	659	1321	113	16	510	1765	105	51	555	1810
Total	132	132	6919	6919	129	129	8844	8844	156	156	9021	9021

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