Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2020

Fecha de Información: 19 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$2023.7 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	559.2	379.1	81.5	306.0	57.9	13.6	239.6
15-35	571.1	650.1	394.3	95.0	94.1	314.5	161.6
36-60	30.0	32.2	0.0	14.5	32.2	15.5	0.0
61-90	40.2	33.5	0.0	0.0	33.5	40.2	0.0
91-180	18.0	29.8	0.0	10.0	24.8	3.0	5.0
>180	30.0	66.7	0.0	20.0	56.7	0.0	10.0
Total	**1248.6**	**1191.3**	**475.8**	**445.5**	**299.2**	**386.8**	**416.3**

* 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	3.7 %	3.4 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	3.7 %	3.2 %	3.5 %
61-90	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.2 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
>180	2.7 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.7 %	3.5 %	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	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**	98	363	6712	6330	21	113	2736	3587	13	109	4496	4198
Intragrupo y off-shore***	0	0	3387	2147	0	0	2076	563	0	0	2478	1561
Otros	363	98	959	2581	113	21	634	1297	109	13	383	1599
Total	**462**	**462**	**11058**	**11058**	**134**	**134**	**5446**	**5446**	**122**	**122**	**7358**	**7358**

* 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.