

Fecha de Publicación: 3 de junio de 2020

Fecha de Información: 01 de junio 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\$1420.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	394.6	374.4	105.0	120.5	141.9	146.7	127.5
15-35	333.0	316.9	118.6	59.2	49.3	124.8	149.0
36-60	11.2	26.8	14.0	8.5	12.8	2.7	0.0
61-90	146.7	26.0	0.0	0.0	26.0	146.7	0.0
91-180	17.0	21.8	0.0	0.0	21.8	17.0	0.0
>180	12.9	15.9	8.0	0.0	7.9	12.9	0.0
Total	915.4	781.8	245.6	188.2	259.8	450.7	276.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.4 %	3.2 %	3.2 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.2 %	3.4 %
36-60	-	3.4 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.6 %
Total	3.5 %	3.3 %	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	1 al 5 de junio				8 al 12 de junio				15 al 19 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	90	5687	5349	52	103	5332	5712	25	115	4545	4446
Intragruppo y off-shore***	0	0	2996	2000	0	0	3283	1719	2	0	2482	963
Otros	90	19	511	1843	103	52	693	1877	113	25	652	2269
Total	109	109	9193	9193	155	155	9308	9308	139	139	7679	7679

* 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 intragruppo.