

Fecha de Publicación: 4 de junio de 2020

Fecha de Información: 02 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\$1846.3 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	365.2	325.1	58.0	188.0	100.1	10.2	167.0
15-35	740.1	592.5	194.5	218.8	37.5	160.9	360.5
36-60	21.8	36.8	16.4	0.0	20.4	21.8	0.0
61-90	0.3	51.4	0.0	0.0	51.4	0.3	0.0
91-180	61.1	80.1	0.0	0.0	80.1	61.1	0.0
>180	47.7	54.7	0.0	19.9	51.7	24.8	3.0
Total	1236.2	1140.6	268.9	426.7	341.2	279.1	530.5

* 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	3.3 %	3.6 %	2.6 %	3.1 %
15-35	3.5 %	3.3 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.5 %	3.2 %	3.4 %
61-90	-	3.4 %	2.1 %	3.4 %
91-180	-	3.3 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %
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	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	87	5933	5504	53	103	5413	5867	25	115	4714	4599
Intragrupo y off-shore***	0	0	3046	2138	0	0	3291	1745	2	0	2501	1000
Otros	87	19	512	1849	103	53	786	1879	113	25	660	2275
Total	106	106	9491	9491	157	157	9491	9491	140	140	7875	7875

* 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.