

Fecha de Publicación: 8 de junio de 2020

Fecha de Información: 04 de junio de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1728.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	488.7	411.8	35.0	114.4	76.3	73.7	300.5
15-35	718.4	328.2	92.9	122.3	13.8	374.7	221.5
36-60	1.9	17.3	0.0	0.0	17.3	1.9	0.0
61-90	32.5	40.0	0.0	0.0	10.0	2.5	30.0
91-180	68.7	137.9	2.2	0.0	100.7	33.7	35.0
>180	17.6	52.8	4.5	15.0	48.4	2.6	0.0
Total	1327.9	988.0	134.6	251.7	266.5	489.2	587.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.2 %	3.4 %	3.1 %	3.2 %
15-35	3.4 %	3.4 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.5 %	2.6 %	3.5 %
61-90	3.2 %	3.5 %	2.6 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	-	3.2 %	2.8 %	3.1 %
Total	3.3 %	3.3 %	3.2 %	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**	26	87	6367	5634	56	102	5927	6338	25	115	4963	4815
Intragruo y off-shore***	0	0	3082	2477	0	0	3392	1934	2	0	2526	1075
Otros	87	26	519	1856	102	56	907	1954	113	25	692	2291
Total	113	113	9967	9967	158	158	10226	10226	140	140	8181	8181

* 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 intragruo.