

Fecha de Publicación: 9 de junio de 2020

Fecha de Información: 05 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\$1563.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	266.7	375.2	113.4	31.0	44.9	18.8	216.9
15-35	617.4	304.9	110.5	246.9	54.7	230.8	139.7
36-60	0.2	29.9	0.0	0.0	29.9	0.2	0.0
61-90	12.8	37.5	5.2	0.0	32.3	12.8	0.0
91-180	35.1	145.7	15.0	0.0	100.7	5.1	30.0
>180	102.8	24.5	0.0	0.0	21.5	99.8	3.0
Total	1035.2	917.9	244.1	277.9	284.2	367.7	389.6

* 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	3.5 %	3.4 %	3.2 %	3.4 %
15-35	3.6 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.7 %	2.9 %	3.7 %
61-90	-	3.5 %	3.1 %	3.4 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.9 %	3.3 %	2.8 %	2.9 %
Total	3.5 %	3.4 %	3.2 %	3.4 %

* 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	85	6378	5635	67	109	6150	6651	32	114	4994	4866
Intragrupo y off-shore***	0	0	3082	2477	0	0	3495	1951	2	0	2536	1089
Otros	85	26	519	1867	109	67	910	1953	112	32	723	2298
Total	111	111	9979	9979	177	177	10555	10555	146	146	8253	8253

* 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 intragrupo.