

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2020

Fecha de Información: 08 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\$1928.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	174.2	436.4	287.1	30.5	25.3	19.7	124.0
15-35	932.5	592.4	204.9	208.0	14.3	351.3	373.2
36-60	61.1	53.8	0.0	9.8	3.8	1.4	50.0
61-90	17.4	16.7	0.0	0.0	14.7	15.4	2.0
91-180	58.9	109.8	0.0	0.0	99.8	48.9	10.0
>180	27.1	32.4	1.2	0.0	6.2	2.1	25.0
Total	1271.3	1241.5	493.2	248.3	164.1	438.8	584.2

* 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	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.5 %	2.9 %	3.2 %
36-60	3.3 %	7.8 %	3.1 %	3.5 %
61-90	3.2 %	4.5 %	3.1 %	3.8 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	2.9 %	2.9 %	2.5 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.4 %	2.9 %	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	8 al 12 de junio				15 al 19 de junio				22 al 26 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	75	123	6258	6951	33	115	5054	4990	24	353	4586	3771
Intragruppo y off-shore***	0	0	3682	1951	2	0	2635	1119	0	0	1903	804
Otros	123	75	916	1955	113	33	731	2310	353	24	588	2502
Total	198	198	10856	10856	147	147	8420	8420	377	377	7077	7077

* 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.