

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2020

Fecha de Información: 09 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\$1537.2 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	326.4	397.0	169.7	103.1	17.8	13.8	209.5
15-35	543.8	574.3	227.0	101.7	56.8	151.6	290.5
36-60	4.5	48.4	43.2	0.0	5.2	4.5	0.0
61-90	7.6	28.7	2.5	0.0	24.4	5.8	1.8
91-180	25.2	62.5	13.0	0.0	49.5	25.2	0.0
>180	8.6	15.6	0.0	0.0	12.1	5.1	3.5
Total	916.0	1126.5	455.4	204.8	165.8	206.0	505.3

* 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 %	3.5 %	1.7 %	3.0 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	3.4 %	2.7 %	3.3 %
61-90	3.1 %	4.0 %	3.1 %	3.8 %
91-180	-	3.1 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.7 %	3.0 %	2.5 %	2.9 %
Total	3.3 %	3.4 %	2.8 %	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	134	6552	7229	33	114	5085	5043	24	354	4677	3989
Intragruppo y off-shore***	0	0	3762	2045	2	0	2665	1128	0	0	2036	810
Otros	134	75	919	1959	112	33	739	2318	354	24	599	2513
Total	209	209	11233	11233	147	147	8489	8489	378	378	7312	7312

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.