

Fecha de Publicación: 12 de junio de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2592.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	631.9	309.2	139.0	466.5	14.4	9.5	155.9
15-35	502.6	1022.0	716.3	64.6	51.8	184.1	254.0
36-60	0.7	7.0	0.0	0.0	7.0	0.7	0.0
61-90	16.1	51.6	40.0	0.0	11.6	16.1	0.0
91-180	37.6	220.1	90.0	0.0	100.1	7.6	30.0
>180	31.4	202.0	201.3	20.0	0.7	11.4	0.0
Total	1220.4	1812.0	1186.6	551.1	185.6	229.5	439.9

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.8 %		2.8 %	2.4 %	2.6 %
15-35	3.2 %		3.3 %	3.1 %	3.3 %
36-60	-		3.6 %	2.8 %	3.5 %
61-90	-		3.4 %	3.0 %	3.3 %
91-180	2.9 %		3.1 %	2.7 %	3.1 %
>180	-		2.8 %	2.8 %	2.8 %
Total	3.0 %		3.2 %	2.7 %	3.0 %

*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**	79	136	7085	7764	34	112	5180	5081	24	353	4685	4079
Intragruo y off-shore***	0	0	4169	2442	2	0	2674	1198	0	0	2119	810
Otros	136	79	913	1961	110	34	746	2322	353	24	606	2521
Total	214	214	12167	12167	146	146	8601	8601	377	377	7410	7410

* 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.