

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2353.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	594.1	332.8	90.0	434.9	100.3	16.7	142.5
15-35	574.6	769.4	582.1	133.0	11.6	265.8	175.8
36-60	98.1	15.5	0.6	0.0	15.0	98.1	0.0
61-90	29.1	27.5	10.0	10.0	5.5	7.1	12.0
91-180	97.1	80.3	55.0	15.0	15.3	72.1	10.0
>180	39.6	52.9	25.0	12.0	10.4	10.1	17.5
Total	1432.6	1278.5	762.6	604.9	158.1	469.9	357.8

* 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	
3-14	3.7 %	3.5 %	3.6 %	3.6 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-	3.8 %	3.3 %	3.4 %
61-90	3.3 %	3.6 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.0 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.9 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
Total	3.6 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %

*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	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	193	6328	5628	25	79	2716	2924	14	318	3675	3736
Intragrupo y off-shore***	0	0	2595	1756	0	0	1509	987	0	0	2234	1034
Otros	193	35	1128	2667	79	25	299	611	318	14	349	1488
Total	228	228	10051	10051	104	104	4523	4523	332	332	6258	6258

* 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 intragrupo.