Fecha de Publicación: 16 de junio de 2020

Fecha de Información: 11 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$2805.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.[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	710.2	733.6	304.0	277.3	13.4	16.7	416.2
15-35	782.3	922.7	742.7	56.0	16.0	562.3	164.0
36-60	37.0	12.9	0.0	0.0	12.9	37.0	0.0
61-90	17.3	8.3	0.0	0.0	8.3	17.3	0.0
91-180	79.9	63.1	13.3	9.5	19.8	40.4	30.0
>180	23.6	32.2	0.0	10.0	25.2	6.6	7.0
Total	**1650.2**	**1772.9**	**1060.0**	**352.8**	**95.7**	**680.2**	**617.2**

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	3.3 %	2.1 %	3.1 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
36-60	-	3.6 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	3.5 %	2.9 %	3.1 %
91-180	3.0 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %
>180	2.8 %	2.9 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.5 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %

*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**	77	130	7370	8026	38	113	5467	5400	24	354	4834	4266
Intragrupo y off-shore***	0	0	4361	2642	2	0	2765	1261	0	0	2181	825
Otros	130	77	906	1969	111	38	755	2327	354	24	612	2535
Total	**207**	**207**	**12636**	**12636**	**151**	**151**	**8987**	**8987**	**378**	**378**	**7626**	**7626**

* 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.