Fecha de Publicación: 17 de junio de 2020

Fecha de Información: 12 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$1978.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.[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	327.9	500.6	276.8	103.1	29.4	30.3	194.5
15-35	463.4	766.7	510.7	86.3	71.1	192.3	184.9
36-60	20.9	13.5	0.0	2.2	13.5	18.7	0.0
61-90	62.6	28.5	5.0	31.5	8.5	16.1	15.0
91-180	79.4	54.9	20.0	46.0	24.9	23.4	10.0
>180	49.5	42.5	7.4	20.0	7.1	1.5	28.0
Total	**1003.8**	**1406.7**	**819.9**	**289.0**	**154.5**	**282.3**	**432.4**

* 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	3.3 %	3.4 %	2.7 %	3.2 %
15-35	3.4 %	3.4 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.2 %	3.5 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.4 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.7 %	3.2 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.3 %	3.4 %	3.1 %	3.3 %

*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**	78	130	7371	8026	40	154	5744	5713	25	355	4880	4399
Intragrupo y off-shore***	0	0	4361	2642	2	0	2928	1355	0	0	2295	834
Otros	130	78	905	1970	152	40	730	2334	355	25	612	2553
Total	**207**	**207**	**12638**	**12638**	**195**	**195**	**9402**	**9402**	**380**	**380**	**7787**	**7787**

* 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.