

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2020

Fecha de Información: 16 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\$2014.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	318.4	283.2	149.8	143.5	24.7	66.2	108.8
15-35	537.5	557.6	385.8	116.3	16.6	266.1	155.2
36-60	27.8	41.8	0.0	5.6	35.8	16.2	6.0
61-90	4.3	14.0	0.0	3.5	14.0	0.8	0.0
91-180	81.0	271.1	189.5	39.0	47.1	7.5	34.5
>180	119.5	101.7	53.0	72.5	9.7	8.0	39.0
Total	1088.5	1269.5	778.1	380.4	148.0	364.8	343.4

* 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	3.4 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.3 %	3.4 %
36-60	3.3 %	3.4 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	4.2 %	3.0 %	3.9 %
91-180	3.0 %	3.3 %	2.8 %	3.1 %
>180	2.9 %	3.3 %	2.6 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.5 %	3.2 %	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

Sector	15 al 19 de junio				22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	155	5944	5941	28	353	4943	4425	14	88	2343	2529
Intragrupa y off-shore***	2	0	3072	1464	0	0	2300	847	0	0	1319	804
Otros	153	45	730	2340	353	28	632	2603	88	14	261	590
Total	200	200	9745	9745	381	381	7875	7875	103	103	3923	3923

* 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.