

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2020

Fecha de Información: 17 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\$2662.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	382.1	294.6	189.5	273.0	23.2	27.2	81.9
15-35	677.8	605.0	434.9	274.5	14.6	247.9	155.5
36-60	194.5	294.3	172.4	157.9	101.9	16.6	20.0
61-90	2.8	296.7	250.0	0.0	46.7	2.8	0.0
91-180	8.6	85.4	56.0	0.0	24.9	4.1	4.5
>180	31.3	50.7	10.0	20.0	40.7	11.3	0.0
Total	1297.2	1626.7	1112.8	725.4	252.0	309.9	261.9

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.6 %	3.8 %	3.5 %	3.6 %
15-35	3.7 %	3.6 %	3.4 %	3.6 %
36-60	3.5 %	3.6 %	3.2 %	3.6 %
61-90	-	3.2 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.2 %	2.9 %	3.2 %
>180	-	2.8 %	2.5 %	2.7 %
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.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	38	159	6153	6025	27	352	5034	4598	14	86	2444	2631
Intragruppo y off-shore***	2	0	3141	1661	0	0	2400	860	0	0	1382	867
Otros	157	38	730	2339	352	27	648	2624	86	14	268	596
Total	197	197	10024	10024	379	379	8082	8082	100	100	4094	4094

* 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.