

Fecha de Publicación: 24 de junio de 2020

Fecha de Información: 19 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\$2686.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	196.0	548.8	104.9	122.0	378.7	8.8	65.2
15-35	491.9	713.6	495.6	225.0	13.0	61.9	205.0
36-60	419.5	57.8	0.0	41.0	57.8	378.5	0.0
61-90	28.9	54.7	0.0	0.0	34.7	8.9	20.0
91-180	225.3	244.0	195.0	48.9	20.0	147.4	29.0
>180	20.1	9.8	0.0	10.0	4.8	5.1	5.0
Total	1381.6	1628.7	795.5	446.9	509.0	610.6	324.2

* 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	3.0 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
15-35	3.7 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	3.5 %	3.3 %	3.3 %
61-90	3.5 %	4.0 %	3.2 %	3.7 %
91-180	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.7 %	2.9 %	2.6 %	2.7 %
Total	3.5 %	3.6 %	3.3 %	3.4 %

*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**	38	162	6308	6084	28	143	5319	5236	20	86	2650	2773
Intragruppo y off-shore***	2	0	3193	1817	0	0	2526	973	0	0	1441	987
Otros	160	38	732	2333	143	28	1027	2663	86	20	275	605
Total	199	199	10234	10234	171	171	8872	8872	105	105	4366	4366

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