

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2020

Fecha de Información: 23 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\$2081.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	558.6	302.0	124.2	380.5	18.7	19.0	159.1
15-35	536.0	526.7	427.7	212.1	34.1	258.9	64.9
36-60	46.5	41.7	12.5	0.0	9.2	26.5	20.0
61-90	19.0	42.9	13.7	11.2	24.7	3.3	4.5
91-180	189.8	56.3	5.0	30.0	31.8	140.3	19.5
>180	27.2	28.2	0.0	0.0	3.2	2.2	25.0
Total	1377.0	997.8	583.1	633.9	121.7	450.2	293.0

* 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 %	4.1 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.8 %	3.8 %	3.5 %	3.7 %
36-60	3.5 %	4.1 %	3.5 %	3.6 %
61-90	3.6 %	3.8 %	3.3 %	3.7 %
91-180	3.3 %	3.5 %	3.0 %	3.1 %
>180	3.0 %	3.4 %	2.1 %	3.0 %
Total	3.6 %	3.8 %	3.4 %	3.6 %

*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	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	151	5862	5466	23	85	2657	2833	14	317	3617	3656
Intragrupa y off-shore***	0	0	2585	1354	0	0	1489	987	0	0	2174	1002
Otros	151	31	1039	2666	85	23	287	612	317	14	349	1481
Total	182	182	9486	9486	107	107	4433	4433	331	331	6139	6139

* 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.