Fecha de Publicación: 30 de junio de 2020

Fecha de Información: 25 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$3026.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.[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	506.1	354.8	224.5	377.5	50.8	49.2	79.5
15-35	933.3	920.1	687.4	254.0	34.2	480.8	198.5
36-60	160.5	31.3	0.0	0.0	31.3	160.5	0.0
61-90	10.7	133.5	117.5	0.0	6.0	0.7	10.0
91-180	58.5	176.5	112.0	0.0	39.5	33.5	25.0
>180	20.4	51.7	31.0	0.0	2.7	2.4	18.0
Total	**1689.6**	**1667.8**	**1172.4**	**631.5**	**164.4**	**727.2**	**331.0**

* 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	3.2 %	2.5 %	3.1 %	3.0 %
15-35	3.4 %	3.4 %	3.3 %	3.3 %
36-60	-	3.5 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.1 %	3.2 %	2.5 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.8 %	2.7 %	2.3 %	2.7 %
Total	3.3 %	3.2 %	3.2 %	3.2 %

*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	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**	35	201	6583	5700	26	75	2800	3152	56	317	3817	3810
Intragrupo y off-shore***	0	0	2656	2011	0	0	1657	999	0	0	2249	1145
Otros	201	35	1133	2661	75	26	309	615	317	56	377	1489
Total	**236**	**236**	**10373**	**10373**	**102**	**102**	**4767**	**4767**	**374**	**374**	**6443**	**6443**

* 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.