Fecha de Publicación: 2 de julio de 2020

Fecha de Información: 30 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$1099.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.[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	212.4	194.0	78.3	41.9	6.0	60.7	109.7
15-35	356.8	319.0	175.1	171.0	43.9	85.8	100.0
36-60	22.3	28.5	0.0	0.0	28.5	22.3	0.0
61-90	12.3	21.3	0.0	0.0	11.3	2.3	10.0
91-180	30.4	22.3	0.0	6.3	22.3	24.1	0.0
>180	53.9	65.8	20.0	10.0	25.8	23.9	20.0
Total	**688.1**	**650.9**	**273.4**	**229.2**	**137.8**	**219.2**	**239.7**

* 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	3.5 %	3.8 %	3.4 %	3.5 %
15-35	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	3.5 %	3.0 %	3.2 %
61-90	3.1 %	3.3 %	2.7 %	3.2 %
91-180	-	3.1 %	2.9 %	2.9 %
>180	2.8 %	2.9 %	2.2 %	2.6 %
Total	3.4 %	3.4 %	3.1 %	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

Sectores	29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio				13 al 17 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	86	3328	3565	107	320	4000	3988	34	123	3574	3543
Intragrupo y off-shore***	0	0	1826	1261	0	0	2285	1190	0	0	2005	790
Otros	86	29	324	653	320	107	400	1506	123	34	543	1789
Total	**115**	**115**	**5478**	**5478**	**427**	**427**	**6685**	**6685**	**158**	**158**	**6122**	**6122**

* 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.