

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2020

Fecha de Información: 02 de julio 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\$1420.1 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	319.6	273.7	71.6	135.7	67.2	49.0	134.9
15-35	488.9	365.3	133.8	247.3	52.9	63.0	178.7
36-60	7.3	27.0	0.0	0.0	27.0	7.3	0.0
61-90	0.1	110.4	80.0	0.0	30.4	0.1	0.0
91-180	59.5	90.1	10.0	0.0	40.1	19.5	40.0
>180	22.0	29.6	0.0	0.0	9.6	2.0	20.0
Total	897.5	896.2	295.3	383.0	227.3	141.0	373.6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	3.9 %	2.9 %	3.4 %
15-35	3.5 %	3.9 %	3.3 %	3.6 %
36-60	-	5.4 %	3.2 %	4.9 %
61-90	-	3.5 %	3.0 %	3.5 %
91-180	3.1 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
>180	2.9 %	3.1 %	2.2 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.9 %	3.1 %	3.5 %

* 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**	32	92	3529	3674	110	335	4303	4448	34	124	3702	3669
Intragruppo y off-shore***	0	0	1875	1412	0	0	2534	1272	0	0	2033	839
Otros	92	32	340	658	335	110	420	1538	124	34	592	1817
Total	124	124	5744	5744	444	444	7257	7257	158	158	6326	6326

* 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 intragruppo.