Fecha de Publicación: 7 de julio de 2020

Fecha de Información: 03 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$1194.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.[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	239.9	104.2	59.7	199.2	7.8	4.0	36.7
15-35	323.4	347.5	176.6	82.2	11.4	81.7	159.5
36-60	0.4	83.0	70.0	0.0	13.0	0.4	0.0
61-90	0.1	20.5	10.0	0.0	10.5	0.1	0.0
91-180	30.2	58.4	20.0	0.0	33.4	25.2	5.0
>180	78.0	118.1	81.4	70.0	28.7	0.0	8.0
Total	**672.0**	**731.7**	**417.7**	**351.4**	**104.8**	**111.4**	**209.2**

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

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	3530	3674	112	122	4412	4479	34	124	3831	3734
Intragrupo y off-shore***	0	0	1875	1412	0	0	2565	1373	0	0	2061	937
Otros	92	32	340	659	122	112	414	1539	124	34	598	1818
Total	**124**	**124**	**5745**	**5745**	**233**	**233**	**7391**	**7391**	**158**	**158**	**6490**	**6490**

* 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.