

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2019.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	422.1	286.4	54.1	223.9	64.3	30.2	168.0
15-35	666.0	558.9	248.0	298.9	35.9	92.1	275.0
36-60	29.0	31.9	0.0	0.0	31.9	29.0	0.0
61-90	74.9	37.5	0.0	0.0	27.5	64.9	10.0
91-180	115.7	262.6	185.0	10.0	42.6	70.7	35.0
>180	4.0	22.0	0.0	0.0	18.5	0.5	3.5
Total	1311.8	1199.3	487.1	532.8	220.8	287.5	491.5

* 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	3.9 %	3.8 %	3.8 %	3.9 %
15-35	4.1 %	4.2 %	3.9 %	4.0 %
36-60	-	4.7 %	3.4 %	4.0 %
61-90	3.7 %	3.6 %	2.9 %	3.2 %
91-180	3.4 %	3.4 %	3.0 %	3.3 %
>180	3.0 %	3.2 %	2.5 %	3.1 %
Total	4.0 %	3.8 %	3.6 %	3.8 %

*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	6 al 10 de julio				13 al 17 de julio				20 al 24 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	119	130	5409	5035	34	137	4682	5240	52	117	3714	3799
Intragruppo y off-shore***	0	0	2809	2015	0	0	2609	1356	0	0	2471	946
Otros	130	119	406	1573	137	34	1188	1884	117	52	313	1754
Total	249	249	8623	8623	171	171	8480	8480	169	169	6499	6499

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.