

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2020

Fecha de Información: 17 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\$2411.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	422.8	807.6	223.6	230.5	403.4	11.7	180.6
15-35	290.7	402.2	260.1	122.0	5.0	31.4	137.2
36-60	393.3	30.5	25.0	0.0	5.5	393.3	0.0
61-90	60.8	56.8	30.0	20.0	1.8	15.8	25.0
91-180	81.0	82.3	79.6	2.4	2.7	78.6	0.0
>180	75.7	53.7	40.0	60.0	10.2	12.2	3.5
Total	1324.3	1433.0	658.2	434.9	428.5	543.1	346.3

* 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	3.6 %	3.7 %	2.1 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.5 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-	3.4 %	3.4 %	3.4 %
61-90	3.4 %	3.3 %	3.1 %	3.3 %
91-180	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.7 %	2.9 %
Total	3.5 %	3.6 %	3.0 %	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

Sector	13 al 17 de julio				20 al 24 de julio				27 al 31 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	155	6068	5704	61	125	4412	4989	22	349	3315	3945
Intragruppo y off-shore***	0	0	2847	2469	0	0	2925	1347	0	0	2139	1020
Otros	155	38	1212	1946	125	61	782	1783	349	22	599	1088
Total	193	193	10127	10119	186	186	8119	8119	371	371	6054	6054

* 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.