

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2020

Fecha de Información: 21 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\$2893.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	727.9	324.8	139.1	550.3	38.7	30.6	147.0
15-35	525.5	616.6	523.9	370.8	12.7	74.7	80.0
36-60	25.3	50.7	38.4	0.0	12.3	25.3	0.0
61-90	17.2	101.0	77.1	0.0	23.9	17.2	0.0
91-180	3.7	340.6	320.0	0.0	20.6	3.7	0.0
>180	228.1	182.7	135.0	195.0	23.7	9.1	24.0
Total	1527.7	1616.4	1233.5	1116.1	131.9	160.5	251.0

* 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 %	2.0 %	2.6 %
15-35	3.5 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.7 %	3.3 %	3.4 %
61-90	-	3.5 %	3.1 %	3.4 %
91-180	-	3.2 %	3.0 %	3.2 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.6 %	2.9 %
Total	3.5 %	3.5 %	2.4 %	3.0 %

* 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	20 al 24 de julio				27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	65	127	5061	5128	23	349	3384	4122	14	109	3206	3638
Intragrupo y off-shore***	0	0	2929	1857	0	0	2269	1059	0	0	2363	956
Otros	127	65	787	1793	349	23	630	1102	109	14	238	1213
Total	192	192	8777	8777	373	373	6283	6283	123	123	5807	5807

* 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 intragrupo.