

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2020

Fecha de Información: 21 de julio de 2020¹

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.