

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2020

Fecha de Información: 23 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\$2323.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	335.3	303.5	81.9	132.9	76.5	57.3	145.1
15-35	690.5	666.2	405.7	107.5	27.7	350.3	232.8
36-60	52.6	62.3	60.0	0.0	2.3	52.6	0.0
61-90	56.0	44.2	0.0	0.0	44.2	56.0	0.0
91-180	220.9	63.4	50.0	20.0	13.4	200.9	0.0
>180	92.2	164.5	40.0	38.0	74.5	4.2	50.0
Total	1447.5	1304.2	637.6	298.4	238.7	721.2	427.9

* 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 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.5 %	3.2 %	3.3 %
61-90	-	3.5 %	3.1 %	3.3 %
91-180	-	3.3 %	3.1 %	3.1 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
Total	3.4 %	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	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**	69	131	5556	5337	27	347	3691	4554	15	110	3290	3731
Intragruppo y off-shore***	0	0	3022	2261	0	0	2431	1134	0	0	2387	956
Otros	131	69	808	1789	347	27	722	1156	110	15	240	1231
Total	200	200	9386	9386	374	374	6844	6844	124	124	5917	5917

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