

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2020

Fecha de Información: 24 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\$1537.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	371.5	304.0	117.0	166.0	13.8	32.3	173.2
15-35	442.4	453.5	230.1	199.2	56.8	76.5	166.7
36-60	7.4	5.1	0.0	0.0	5.1	7.4	0.0
61-90	128.8	47.6	0.0	10.0	2.6	73.8	45.0
91-180	126.8	34.5	0.0	0.0	9.5	101.8	25.0
>180	4.1	22.0	0.0	0.0	22.0	4.1	0.0
Total	1081.0	866.7	347.1	375.2	109.7	296.0	409.9

* 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	3.5 %	3.5 %	2.6 %	3.1 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	4.1 %	3.2 %	3.6 %
61-90	3.3 %	3.8 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.3 %	3.1 %	3.1 %
>180	-	3.2 %	2.6 %	3.1 %
Total	3.5 %	3.5 %	3.1 %	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

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	132	5556	5337	29	349	3892	4760	15	109	3457	3864
Intragrupo y off-shore***	0	0	3022	2261	0	0	2550	1244	0	0	2425	1012
Otros	132	69	808	1789	349	29	731	1170	109	15	240	1246
Total	201	201	9386	9386	377	377	7174	7174	124	124	6122	6122

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