

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2020

Fecha de Información: 27 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\$1848.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	226.1	253.6	106.1	107.2	40.5	11.9	107.0
15-35	720.2	371.5	182.8	430.8	103.2	204.0	85.5
36-60	15.4	22.2	13.7	6.2	3.5	4.2	5.0
61-90	70.3	6.7	0.1	0.0	6.6	70.3	0.0
91-180	25.5	242.8	220.0	8.6	17.8	11.9	5.0
>180	7.4	91.7	87.3	0.0	1.4	4.4	3.0
Total	1064.9	988.6	610.0	552.8	173.1	306.7	205.5

* 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	3.3 %	3.6 %	3.6 %	3.5 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	3.2 %	3.8 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.6 %	3.2 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.0 %
>180	2.7 %	3.4 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.3 %	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	27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	360	4091	4952	17	109	3476	3899	24	149	4231	5483
Intragrupo y off-shore***	0	0	2647	1341	0	0	2435	1022	0	0	3185	1543
Otros	360	34	720	1164	109	17	265	1255	149	24	1018	1359
Total	394	394	7457	7457	127	127	6176	6176	173	173	8434	8384

* 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.