

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2020

Fecha de Información: 28 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\$2249.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	788.6	431.5	113.5	444.4	32.3	58.5	285.7
15-35	323.6	707.3	462.2	113.9	93.3	58.0	151.7
36-60	45.5	50.3	44.8	28.0	5.5	17.5	0.0
61-90	55.0	98.2	13.6	0.0	59.6	30.0	25.0
91-180	72.2	68.7	10.0	20.0	48.7	42.2	10.0
>180	33.2	53.0	46.8	10.0	1.2	18.2	5.0
Total	1318.1	1409.0	691.0	616.3	240.6	224.4	477.4

* 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	3.2 %		3.3 %	2.2 %	2.7 %
15-35	3.2 %		3.2 %	2.7 %	3.1 %
36-60	-		3.2 %	3.0 %	3.1 %
61-90	3.0 %		3.2 %	2.9 %	3.1 %
91-180	2.9 %		3.1 %	2.8 %	3.0 %
>180	2.7 %		2.7 %	2.5 %	2.6 %
Total	3.2 %		3.2 %	2.4 %	2.9 %

*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**	35	365	4586	5064	19	110	3595	4030	24	149	4534	5764
Intragrupo y off-shore***	0	0	2665	1710	0	0	2497	1086	0	0	3219	1591
Otros	365	35	726	1203	110	19	291	1267	149	24	1016	1364
Total	400	400	7977	7977	130	130	6383	6383	173	173	8769	8719

* 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.