

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2020

Fecha de Información: 29 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\$2546.7 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	782.0	259.1	36.5	245.4	21.7	335.7	200.9
15-35	576.6	936.3	474.0	85.5	91.3	120.1	371.0
36-60	65.0	105.6	14.0	2.6	31.6	2.4	60.0
61-90	127.7	103.2	10.0	62.1	38.2	10.6	55.0
91-180	150.8	158.2	10.0	10.0	8.2	0.8	140.0
>180	55.3	78.9	50.0	10.0	3.9	20.3	25.0
Total	1757.3	1641.3	594.5	415.6	194.9	489.8	851.9

* 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	3.0 %	3.5 %	2.7 %	2.8 %
15-35	2.9 %	3.0 %	2.7 %	2.9 %
36-60	3.1 %	3.1 %	2.6 %	3.1 %
61-90	2.8 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %
91-180	2.8 %	3.4 %	2.1 %	2.8 %
>180	2.7 %	3.0 %	2.6 %	2.7 %
Total	2.9 %	3.1 %	2.7 %	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**	42	172	4908	5160	26	132	3861	4114	28	369	4731	5846
Intragrupo y off-shore***	0	10	2679	1948	10	0	2509	1086	0	0	3229	1597
Otros	172	32	726	1204	122	26	294	1463	369	28	1028	1495
Total	214	214	8313	8313	158	158	6663	6663	397	397	8988	8938

* 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.