

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2020

Fecha de Información: 22 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\$2525.3 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	569.0	428.2	197.6	358.2	37.0	17.1	193.7
15-35	562.1	744.5	473.1	266.8	20.4	44.3	251.0
36-60	63.0	9.9	0.9	0.0	9.0	63.0	0.0
61-90	36.8	15.1	10.0	0.0	5.1	36.8	0.0
91-180	126.0	189.3	160.0	0.0	24.3	121.0	5.0
>180	127.9	108.1	100.0	120.0	3.1	2.9	5.0
Total	1484.8	1495.2	941.6	745.0	98.9	285.1	454.7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.4 %	2.9 %	3.3 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	3.3 %	3.3 %	3.3 %
61-90	-	3.2 %	3.1 %	3.1 %
91-180	3.2 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	3.0 %	3.1 %	2.7 %	3.0 %
Total	3.5 %	3.4 %	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	130	5439	5282	25	346	3518	4369	14	109	3246	3666
Intragruppo y off-shore***	0	0	3014	2178	0	0	2381	1084	0	0	2363	956
Otros	130	69	798	1791	346	25	657	1103	109	14	238	1225
Total	199	199	9251	9251	372	372	6556	6556	124	124	5847	5847

* 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 intragruppo.