

Fecha de Publicación: 1 de julio de 2020

Fecha de Información: 26 de junio 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\$2383.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	576.2	423.5	127.3	265.2	37.5	52.4	258.7
15-35	625.7	680.8	415.7	128.2	131.0	363.4	134.1
36-60	53.3	26.3	4.0	0.0	22.3	53.3	0.0
61-90	10.6	123.6	95.5	0.0	18.2	0.6	10.0
91-180	189.2	26.6	0.0	9.3	16.6	169.9	10.0
>180	36.3	24.1	0.0	30.0	24.1	6.3	0.0
Total	1491.3	1304.9	642.5	432.6	249.6	645.9	412.8

* 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	3.3 %	3.3 %	2.0 %	2.8 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
36-60	-	3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.1 %	3.6 %	2.7 %	3.4 %
91-180	3.0 %	3.3 %	2.9 %	2.9 %
>180	-	3.1 %	2.1 %	2.9 %
Total	3.3 %	3.3 %	2.8 %	3.1 %

* 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

Sector	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	202	6582	5701	27	85	3195	3438	100	318	3951	3941
Intragruppo y off-shore***	0	0	2656	2011	0	0	1760	1219	0	0	2273	1190
Otros	202	36	1134	2660	85	27	318	616	318	100	400	1493
Total	238	238	10372	10372	113	113	5273	5273	418	418	6624	6624

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