

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2020

Fecha de Información: 01 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\$1175.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	259.1	376.3	242.0	143.2	23.2	4.9	111.1
15-35	316.1	379.8	231.3	85.0	34.4	117.0	114.1
36-60	13.3	8.8	0.0	0.6	8.8	12.8	0.0
61-90	5.3	7.3	2.2	5.0	5.1	0.3	0.0
91-180	8.5	15.7	0.0	0.0	15.7	8.5	0.0
>180	3.8	9.4	0.0	0.0	6.4	0.8	3.0
Total	606.1	797.3	475.5	233.7	93.6	144.2	228.2

* 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 %	3.9 %	3.2 %	3.4 %
15-35	3.5 %	3.4 %	3.2 %	3.4 %
36-60	-	3.6 %	2.9 %	3.2 %
61-90	-	3.7 %	2.3 %	3.6 %
91-180	-	3.3 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.7 %	3.2 %	2.2 %	2.9 %
Total	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.4 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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 intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio				13 al 17 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	92	3486	3635	109	331	4085	4269	35	120	3642	3616
Intragruppo y off-shore***	0	0	1850	1383	0	0	2495	1211	0	0	2025	793
Otros	92	32	336	654	331	109	406	1505	120	35	546	1803
Total	124	124	5672	5672	440	440	6985	6985	155	155	6213	6213

* 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.