

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2020

Fecha de Información: 08 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\$2585.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	565.0	417.4	277.1	456.5	38.7	6.9	101.6
15-35	703.3	644.7	454.3	246.1	31.7	298.5	158.7
36-60	5.3	12.3	0.2	0.0	12.1	5.3	0.0
61-90	100.5	177.4	105.4	0.0	17.0	45.5	55.0
91-180	82.5	171.4	110.0	52.3	41.4	10.3	20.0
>180	16.2	28.2	20.0	0.0	5.2	13.2	3.0
Total	1472.9	1451.3	966.8	754.8	146.2	379.8	338.3

* 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	3.6 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.1 %	3.4 %
36-60	-	3.9 %	3.3 %	3.7 %
61-90	3.3 %	3.5 %	3.0 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.7 %	2.9 %
Total	3.6 %	3.5 %	3.1 %	3.3 %

*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	6 al 10 de julio				13 al 17 de julio				20 al 24 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	119	131	5255	4930	36	134	4143	4311	52	115	3687	3736
Intragrupo y off-shore***	0	0	2786	1951	0	0	2419	1096	0	0	2430	941
Otros	131	119	407	1565	134	36	685	1839	115	52	312	1752
Total	250	250	8447	8447	169	169	7247	7247	167	167	6429	6429

* 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.