

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2020

Fecha de Información: 13 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\$2441.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	596.1	274.1	156.3	476.3	24.7	26.7	93.1
15-35	699.9	571.9	442.8	377.6	19.1	212.3	110.0
36-60	27.3	223.9	200.0	0.0	3.9	7.3	20.0
61-90	20.2	60.7	36.8	0.0	3.9	0.2	20.0
91-180	2.1	155.9	108.5	0.0	47.5	2.1	0.0
>180	38.2	29.3	0.0	13.2	14.3	10.0	15.0
Total	1383.9	1315.9	944.3	867.1	113.5	258.6	258.1

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	4.1 %	3.2 %	3.2 %	3.4 %
15-35	4.2 %	4.2 %	3.7 %	4.0 %
36-60	3.8 %	4.3 %	3.4 %	3.7 %
61-90	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.6 %
91-180	-	3.5 %	2.9 %	3.5 %
>180	3.1 %	3.0 %	3.0 %	3.1 %
Total	4.0 %	3.8 %	3.4 %	3.7 %

*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	13 al 17 de julio				20 al 24 de julio				27 al 31 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	143	5247	5464	55	120	3733	3841	22	351	2968	3396
Intragruo y off-shore***	0	0	2733	1825	0	0	2504	953	0	0	1814	882
Otros	143	42	1202	1893	120	55	316	1759	351	22	556	1060
Total	185	185	9182	9182	176	176	6554	6554	374	374	5338	5338

* 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 intragruo.