

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2020

Fecha de Información: 15 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\$2277.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	504.6	199.8	109.6	407.1	6.7	14.0	83.5
15-35	696.2	864.8	509.4	301.5	13.4	52.8	342.0
36-60	84.9	33.9	0.0	0.0	33.9	84.9	0.0
61-90	50.3	38.0	3.4	0.0	14.6	30.3	20.0
91-180	29.3	161.0	100.0	14.5	51.0	4.8	10.0
>180	33.7	46.6	21.1	20.0	15.5	3.7	10.0
Total	1399.1	1344.0	743.4	743.1	135.1	190.5	465.5

* 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	4.0 %	4.1 %	3.7 %	3.8 %
15-35	4.1 %	4.0 %	4.0 %	4.0 %
36-60	-	3.7 %	3.7 %	3.7 %
61-90	3.6 %	4.1 %	3.7 %	3.8 %
91-180	3.3 %	3.4 %	3.0 %	3.4 %
>180	3.1 %	3.0 %	2.7 %	3.0 %
Total	-	3.8 %	3.8 %	3.9 %

* 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**	36	156	5988	5663	56	120	3875	4280	22	353	3163	3594
Intragruppo y off-shore***	0	0	2818	2403	0	0	2762	975	0	0	1954	1010
Otros	156	36	1214	1946	120	56	395	1777	353	22	558	1071
Total	192	192	10019	10011	176	176	7032	7032	376	376	5676	5676

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