

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2020

Fecha de Información: 16 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\$2739.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	351.1	285.9	134.0	217.6	35.4	17.0	116.5
15-35	891.3	574.9	341.6	334.9	6.8	329.9	226.5
36-60	7.7	13.4	8.5	0.0	4.9	7.7	0.0
61-90	242.7	61.7	30.0	0.1	1.7	212.6	30.0
91-180	125.8	320.3	236.1	0.0	59.2	100.8	25.0
>180	196.2	116.6	40.0	101.5	26.6	44.7	50.0
Total	1814.8	1372.8	790.2	654.2	134.6	712.6	448.0

* 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	3.7 %	4.1 %	3.6 %	3.7 %
15-35	3.8 %	3.8 %	3.8 %	3.8 %
36-60	-	3.9 %	3.6 %	3.7 %
61-90	3.6 %	3.7 %	3.3 %	3.3 %
91-180	3.2 %	3.3 %	3.2 %	3.2 %
>180	2.9 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %
Total	3.6 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %

*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**	37	158	6064	5704	56	120	4054	4422	22	353	3257	3712
Intragrupo y off-shore***	0	0	2847	2469	0	0	2862	1117	0	0	1979	1020
Otros	158	37	1212	1943	120	56	404	1781	353	22	582	1085
Total	196	196	10124	10116	176	176	7320	7320	376	376	5818	5818

* 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.