

Fecha de Publicación: 3 de agosto de 2020

Fecha de Información: 30 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\$3473.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	850.8	567.8	246.0	520.0	49.8	58.8	272.0
15-35	946.3	1287.7	673.3	243.9	79.4	167.4	535.0
36-60	382.5	266.1	39.5	154.0	6.6	8.5	220.0
61-90	57.0	95.9	70.0	9.0	25.9	48.0	0.0
91-180	12.4	9.9	0.0	8.6	9.9	3.8	0.0
>180	14.5	10.0	0.0	0.0	10.0	14.5	0.0
Total	2263.5	2237.4	1028.8	935.5	181.6	301.0	1027.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.0 %	2.9 %	2.1 %	2.7 %
15-35	3.0 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
36-60	3.0 %	3.0 %	2.4 %	3.0 %
61-90	-	3.0 %	2.7 %	2.8 %
91-180	-	3.3 %	2.3 %	3.1 %
>180	-	3.0 %	2.5 %	2.7 %
Total	3.0 %	2.9 %	2.5 %	2.9 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	169	4995	5179	26	132	4317	4315	31	369	5036	6203
Intragruppo y off-shore***	0	10	2688	2036	10	0	2591	1410	0	0	3384	1705
Otros	169	32	735	1203	122	26	299	1482	369	31	1071	1533
Total	211	211	8419	8419	158	158	7207	7207	400	400	9491	9441

* 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.