

Fecha de Publicación: 4 de agosto de 2020

Fecha de Información: 31 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\$2107.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	252.3	502.8	74.6	116.1	320.2	28.2	108.1
15-35	475.1	693.6	359.1	102.3	21.5	59.8	313.0
36-60	303.1	24.2	22.0	0.1	2.2	303.1	0.0
61-90	14.9	36.9	10.0	0.3	26.9	14.6	0.0
91-180	18.6	143.3	117.8	0.1	20.5	13.5	5.0
>180	68.4	10.4	0.0	25.0	0.4	33.4	10.0
Total	1132.4	1411.2	583.5	243.8	391.7	452.6	436.0

* 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	2.7 %	3.0 %	1.5 %	2.7 %
15-35	2.8 %	2.9 %	2.5 %	2.8 %
36-60	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
61-90	-	1.8 %	2.6 %	2.1 %
91-180	2.7 %	2.8 %	2.6 %	2.8 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.8 %	2.9 %	2.4 %	2.7 %

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

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**	43	168	4994	5179	26	136	4523	4759	32	369	5073	6255
Intragruppo y off-shore***	0	10	2688	2036	10	0	2648	1526	0	0	3401	1705
Otros	168	33	736	1202	126	26	612	1498	369	32	1072	1536
Total	210	210	8418	8418	162	162	7783	7783	401	401	9546	9496

* 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.