

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2020

Fecha de Información: 04 de agosto 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\$1691.1 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	306.5	211.5	146.4	219.3	4.1	26.2	61.0
15-35	281.5	588.0	450.2	108.8	25.3	60.2	112.5
36-60	65.6	115.8	80.1	0.0	35.7	65.6	0.0
61-90	46.9	11.3	0.0	0.0	11.3	46.9	0.0
91-180	97.8	76.2	57.1	25.0	14.1	67.8	5.0
>180	68.4	0.1	0.0	40.0	0.1	28.4	0.0
Total	866.7	1002.9	733.8	393.0	90.5	295.2	178.5

* 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 intragrupo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.6 %	2.9 %	2.0 %	2.2 %
15-35	2.9 %	3.0 %	2.4 %	2.9 %
36-60	-	2.8 %	2.7 %	2.8 %
61-90	-	2.9 %	2.7 %	2.7 %
91-180	2.8 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
>180	-	2.9 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.8 %	2.9 %	2.3 %	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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	131	5074	5092	35	367	5315	6514	33	113	3341	3260
Intragrupo y off-shore***	10	0	2804	1919	0	0	3598	1851	0	0	2060	1185
Otros	121	23	625	1496	367	35	1072	1570	113	33	339	1293
Total	155	155	8503	8506	403	403	9985	9935	146	146	5741	5739

* 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.