

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2350.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	347.0	169.0	122.8	287.4	11.3	24.5	35.0
15-35	865.7	703.9	501.4	225.2	23.5	461.5	179.0
36-60	12.3	33.6	30.0	0.0	3.6	12.3	0.0
61-90	20.2	60.9	0.0	0.0	60.9	20.2	0.0
91-180	132.1	187.9	90.0	0.0	37.9	72.1	60.0
>180	43.6	51.8	43.2	20.0	4.6	19.6	4.0
Total	1421.0	1207.1	787.4	532.6	141.7	610.4	278.0

* 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	2.9 %	2.2 %	1.7 %	2.0 %
15-35	3.1 %	3.1 %	2.8 %	3.0 %
36-60	-	3.0 %	3.1 %	3.1 %
61-90	-	3.7 %	2.8 %	3.5 %
91-180	2.8 %	3.8 %	2.6 %	2.9 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.5 %	2.5 %
Total	3.0 %	3.1 %	2.5 %	2.8 %

*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	10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	342	6256	6970	35	108	3553	3541	29	140	4908	5096
Intragruppo y off-shore***	0	0	3799	2509	0	0	2226	1273	0	0	2544	1499
Otros	342	34	1091	1616	108	35	359	1322	140	29	654	1511
Total	376	376	11146	11096	143	143	6138	6136	170	170	8106	8106

* 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.