

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2020

Fecha de Información: 11 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\$3352.6 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	797.5	526.5	138.0	650.1	287.9	47.0	100.5
15-35	693.6	1021.1	679.1	260.5	20.6	111.6	321.5
36-60	53.8	219.5	185.0	0.0	4.5	23.8	30.0
61-90	5.6	16.5	10.0	0.0	6.5	5.6	0.0
91-180	70.9	77.4	50.0	10.0	17.4	50.9	10.0
>180	290.7	76.5	20.0	0.0	21.5	255.7	35.0
Total	1912.1	1937.5	1082.1	920.6	358.4	494.6	497.0

* 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	3.0 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
15-35	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
36-60	3.0 %	3.0 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	3.2 %	2.6 %	3.0 %
91-180	2.8 %	2.8 %	2.7 %	2.7 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
Total	3.0 %	2.9 %	2.7 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	35	351	6960	7365	35	108	3594	3633	30	139	4937	5143
Intragruppo y off-shore***	0	0	3889	3146	0	0	2259	1285	0	0	2559	1500
Otros	351	35	1345	1633	108	35	388	1321	139	30	662	1516
Total	386	386	12195	12145	143	143	6240	6239	168	168	8158	8158

* 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.