Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2020

Fecha de Información: 03 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$1850.4 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	501.5	376.7	206.6	319.4	4.6	16.6	165.5
15-35	344.6	715.6	578.3	100.5	29.3	136.1	108.0
36-60	41.8	33.8	10.0	10.0	23.8	31.8	0.0
61-90	22.7	5.0	0.0	0.0	5.0	22.7	0.0
91-180	23.4	24.6	12.0	10.0	12.6	13.4	0.0
>180	33.6	0.7	0.0	10.0	0.7	23.6	0.0
Total	**967.5**	**1156.4**	**806.9**	**449.9**	**76.1**	**244.1**	**273.5**

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	2.7 %	2.2 %	2.5 %
15-35	2.8 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	2.9 %	2.5 %	2.7 %
61-90	-	3.7 %	2.5 %	2.7 %
91-180	-	2.8 %	2.6 %	2.7 %
>180	-	2.9 %	2.5 %	2.6 %
Total	2.7 %	2.8 %	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: ((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**	27	130	4809	5030	34	369	5280	6363	29	112	3332	3248
Intragrupo y off-shore***	10	0	2792	1700	0	0	3463	1851	0	0	2055	1185
Otros	120	27	621	1492	369	34	1070	1549	112	29	335	1287
Total	**157**	**157**	**8222**	**8222**	**403**	**403**	**9813**	**9763**	**141**	**141**	**5722**	**5720**

* 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.