Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2020

Fecha de Información: 05 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$2450.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.[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	307.6	202.7	52.8	163.7	22.3	16.4	127.5
15-35	955.8	815.4	443.0	318.0	19.3	284.8	353.0
36-60	17.2	13.2	1.0	0.0	12.3	17.2	0.0
61-90	134.8	390.3	240.9	0.0	39.4	24.8	110.0
91-180	167.2	34.9	15.0	90.0	4.9	62.2	15.0
>180	15.4	1.8	0.0	0.0	1.8	15.4	0.0
Total	**1598.0**	**1458.2**	**752.7**	**571.7**	**100.0**	**420.9**	**605.5**

* 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	3.2 %	5.2 %	2.7 %	3.3 %
15-35	3.0 %	3.0 %	2.9 %	3.0 %
36-60	-	3.5 %	2.5 %	2.9 %
61-90	2.8 %	3.0 %	2.7 %	2.9 %
91-180	2.8 %	2.9 %	2.7 %	2.7 %
>180	-	3.1 %	2.5 %	2.6 %
Total	3.0 %	3.2 %	2.9 %	3.0 %

*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**	30	139	5235	5175	34	372	5427	6587	33	112	3392	3343
Intragrupo y off-shore***	10	0	2814	2027	0	0	3623	1906	0	0	2078	1185
Otros	129	30	641	1491	372	34	1074	1582	112	33	351	1291
Total	**168**	**168**	**8690**	**8694**	**406**	**406**	**10125**	**10075**	**146**	**146**	**5821**	**5820**

* 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.