

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2020

Fecha de Información: 14 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\$1491.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	315.8	270.2	144.0	217.5	42.7	14.8	83.5
15-35	366.9	437.3	295.2	169.0	17.9	73.7	124.2
36-60	7.4	3.7	0.0	0.0	3.7	7.4	0.0
61-90	33.7	162.2	110.0	0.0	32.2	13.7	20.0
91-180	54.2	45.7	25.0	10.0	5.7	29.2	15.0
>180	21.3	16.2	10.0	20.0	6.2	1.3	0.0
Total	799.3	935.3	584.2	416.5	108.4	140.1	242.7

* 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	2.8 %	2.6 %	1.8 %	2.3 %
15-35	2.9 %	2.7 %	2.8 %	2.8 %
36-60	-	3.4 %	2.4 %	2.7 %
61-90	2.8 %	2.8 %	2.6 %	2.8 %
91-180	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
>180	-	2.5 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.8 %	2.7 %	2.2 %	2.6 %

*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**	37	147	7493	7493	34	342	4290	4206	29	120	5107	5545
Intragruppo y off-shore***	0	0	3939	3607	0	0	2579	1753	0	0	2881	1571
Otros	147	37	1350	1632	342	34	427	1335	120	29	685	1558
Total	185	185	12782	12732	376	376	7296	7295	150	150	8673	8673

* 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.