

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2020

Fecha de Información: 18 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\$2106.2 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	435.7	413.7	297.0	328.0	23.2	14.2	93.5
15-35	468.9	725.0	658.2	279.7	33.8	156.2	33.0
36-60	7.8	102.5	55.0	0.0	42.5	2.8	5.0
61-90	5.0	2.1	0.0	0.0	2.1	5.0	0.0
91-180	64.0	13.5	0.0	0.0	8.5	59.0	5.0
>180	3.0	1.5	0.0	0.0	1.5	3.0	0.0
Total	984.4	1258.3	1010.2	607.7	111.6	240.2	136.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.9 %	3.1 %	2.9 %	2.9 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.7 %	2.8 %
36-60	2.8 %	2.8 %	2.2 %	2.8 %
61-90	-	3.0 %	2.6 %	2.7 %
91-180	2.6 %	2.9 %	2.5 %	2.6 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.9 %	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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	351	4641	4513	30	121	5172	5638	16	97	2551	3137
Intragruppo y off-shore***	0	0	2816	2043	0	0	2941	1609	1	0	2172	841
Otros	351	40	429	1328	121	30	703	1570	96	16	300	1044
Total	391	391	7886	7884	150	150	8817	8817	112	112	5023	5023

* 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.