

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2020

Fecha de Información: 24 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\$1578.2 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	362.0	311.5	135.8	181.3	4.9	9.9	170.8
15-35	394.9	637.8	408.5	131.0	8.4	42.9	221.0
36-60	40.5	51.5	40.4	0.0	11.2	40.5	0.0
61-90	8.8	17.5	0.0	5.8	17.5	3.0	0.0
91-180	88.6	79.6	29.0	30.0	5.6	13.6	45.0
>180	17.9	4.3	0.0	0.2	4.3	17.7	0.0
Total	912.8	1102.2	613.6	348.3	51.9	127.7	436.8

* 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	
3-14	2.9 %	2.8 %	1.1 %	2.1 %
15-35	2.9 %	2.9 %	3.2 %	3.0 %
36-60	-	2.9 %	2.7 %	2.8 %
61-90	-	2.9 %	2.6 %	2.8 %
91-180	2.6 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.4 %	2.4 %
Total	2.9 %	2.9 %	2.2 %	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	24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	133	5986	6848	110	164	2766	3338	13	71	5158	5481
Intragrupo y off-shore***	0	0	3751	2015	1	0	2265	947	0	0	3229	1670
Otros	133	31	736	1610	163	110	305	1051	71	13	407	1644
Total	165	165	10473	10473	274	274	5336	5336	84	84	8795	8795

* 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.