

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2020

Fecha de Información: 25 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\$1688.3 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	564.8	339.8	162.5	399.2	40.8	29.1	136.5
15-35	304.6	586.3	417.2	114.0	20.0	41.5	149.1
36-60	17.9	40.1	10.0	0.0	15.1	2.9	15.0
61-90	0.8	9.6	0.0	0.0	9.6	0.8	0.0
91-180	25.5	14.9	0.0	0.0	14.9	25.5	0.0
>180	67.9	71.7	0.0	0.0	16.7	12.9	55.0
Total	981.6	1062.4	589.7	513.2	117.1	112.7	355.6

* 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	2.9 %	3.1 %	2.3 %	2.6 %
15-35	2.8 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
36-60	2.7 %	2.8 %	2.0 %	2.7 %
61-90	-	2.9 %	2.1 %	2.8 %
91-180	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.1 %	2.5 %
Total	2.8 %	2.9 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	32	139	6415	6971	131	201	2851	3492	13	71	5228	5545
Intragruppo y off-shore***	0	0	3784	2356	1	0	2395	1005	0	0	3244	1685
Otros	139	32	740	1612	200	131	303	1053	71	13	407	1649
Total	171	171	10939	10939	331	331	5550	5550	84	84	8879	8879

* 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.