

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2020

Fecha de Información: 27 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\$2168.7 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	476.0	495.6	269.0	284.1	74.6	39.9	152.0
15-35	626.0	475.4	237.0	310.6	98.4	175.5	140.0
36-60	22.4	75.0	46.1	0.0	28.9	22.4	0.0
61-90	13.8	162.4	130.0	0.0	32.4	13.8	0.0
91-180	16.6	33.5	0.0	0.0	33.5	16.6	0.0
>180	43.5	60.4	0.0	0.1	20.4	3.4	40.0
Total	1198.4	1302.3	682.1	594.8	288.2	271.6	332.0

* 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	2.6 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.8 %	2.5 %	2.7 %
61-90	-	2.6 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	3.0 %	2.4 %	2.8 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
Total	2.6 %	2.7 %	2.4 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$. 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**	33	165	6703	7481	134	199	3285	4036	17	70	5462	5821
Intragrupo y off-shore***	0	0	3821	2554	1	0	2797	1285	0	0	3389	1788
Otros	165	33	1137	1625	198	134	332	1092	70	17	415	1657
Total	197	197	11660	11660	332	332	6414	6414	88	88	9266	9266

* 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.