

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$1986.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	486.1	369.5	195.9	326.7	20.4	6.3	153.2
15-35	476.9	562.6	275.3	78.9	52.6	163.3	234.7
36-60	283.1	295.0	0.0	0.0	45.0	33.1	250.0
61-90	0.8	30.7	0.0	0.0	30.7	0.8	0.0
91-180	52.8	64.8	0.0	14.5	39.8	13.3	25.0
>180	11.2	15.4	0.0	10.0	15.4	1.2	0.0
Total	1310.9	1338.0	471.2	430.0	204.0	217.9	662.9

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	143	215	4248	4871	18	75	5826	6145	41	106	3359	4532
Intragruppo y off-shore***	1	0	3052	1998	0	0	3534	1986	0	0	2916	1300
Otros	214	143	664	1096	75	18	441	1670	106	41	672	1115
Total	358	358	7965	7965	93	93	9801	9801	147	147	6947	6947

* 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.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.