

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 02 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\$2319.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	661.8	406.4	173.0	462.8	54.4	20.0	179.0
15-35	592.4	650.8	399.9	277.9	46.4	110.0	204.5
36-60	119.1	238.4	45.1	0.0	83.3	9.1	110.0
61-90	0.3	28.2	0.0	0.0	28.2	0.3	0.0
91-180	1.9	43.1	5.0	0.0	38.1	1.9	0.0
>180	55.1	15.1	0.0	20.0	15.1	35.1	0.0
Total	1430.6	1382.1	623.1	760.7	265.5	176.3	493.5

* 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	2.2 %	2.5 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.3 %	2.7 %	2.3 %	2.5 %
61-90	-	2.9 %	2.0 %	2.9 %
91-180	-	2.7 %	2.2 %	2.7 %
>180	-	2.7 %	2.3 %	2.4 %
Total	2.3 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %

* 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**	146	223	4584	4879	18	77	6024	6417	42	111	3536	4663
Intragruppo y off-shore***	1	0	3062	2326	0	0	3674	2077	0	0	2939	1372
Otros	222	146	659	1101	77	18	480	1684	111	42	689	1128
Total	369	369	8305	8305	95	95	10178	10178	153	153	7164	7164

* 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 intragruppo.