

Fecha de Publicación: 7 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 03 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\$2010.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	405.3	571.0	209.9	290.7	254.9	8.4	106.2
15-35	312.5	510.9	330.1	147.6	33.3	17.5	147.5
36-60	29.3	49.1	0.0	0.4	49.1	28.9	0.0
61-90	40.2	22.5	1.5	0.0	21.0	40.2	0.0
91-180	12.1	37.4	3.0	1.9	24.4	0.2	10.0
>180	245.5	38.1	20.0	5.0	18.1	240.5	0.0
Total	1044.9	1229.0	564.5	445.6	400.9	335.6	263.7

* 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	2.4 %	2.5 %	1.9 %	2.2 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %
36-60	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	2.8 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.3 %
Total	2.4 %	2.5 %	2.1 %	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**	144	214	4660	4888	17	77	6302	6931	46	114	3585	4728
Intragrupo y off-shore***	1	0	3065	2396	0	0	3871	2289	0	0	2962	1381
Otros	213	144	664	1106	77	17	723	1677	114	46	698	1136
Total	359	359	8390	8390	94	94	10896	10896	159	159	7245	7245

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