

Fecha de Publicación: 8 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 04 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\$2097.1 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	412.3	521.2	322.2	212.0	8.8	10.1	190.2
15-35	812.8	611.1	303.0	308.0	15.1	211.8	293.0
36-60	45.2	14.4	0.0	0.0	14.4	45.2	0.0
61-90	6.4	8.5	0.0	0.0	8.5	6.4	0.0
91-180	12.5	100.8	93.1	12.0	7.7	0.5	0.0
>180	29.3	5.6	0.0	27.1	5.6	2.2	0.0
Total	1318.6	1261.7	718.3	559.1	60.3	276.2	483.2

* 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 %		2.0 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.5 %		2.5 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-		2.7 %	2.3 %	2.4 %
61-90	-		2.8 %	2.2 %	2.5 %
91-180	-		2.5 %	2.4 %	2.5 %
>180	-		2.7 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.5 %		2.3 %	2.2 %	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	216	4664	4885	18	81	6675	7342	44	113	3634	4867
Intragrupo y off-shore***	1	0	3065	2396	0	0	4117	2496	0	0	3067	1396
Otros	215	144	662	1110	81	18	730	1683	113	44	700	1139
Total	360	360	8391	8391	98	98	11521	11521	157	157	7402	7402

* 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.