Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2020

Fecha de Información: 12 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$1815.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.[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	426.3	255.0	120.5	290.2	20.5	22.1	114.0
15-35	525.2	666.4	436.2	131.1	7.2	171.1	223.0
36-60	25.6	37.9	20.0	0.0	2.9	10.6	15.0
61-90	32.3	23.7	0.0	0.0	23.7	32.3	0.0
91-180	2.7	10.6	0.0	0.0	8.6	0.7	2.0
>180	108.4	105.7	55.0	50.0	0.7	8.4	50.0
Total	**1120.6**	**1099.3**	**631.7**	**471.3**	**63.6**	**245.2**	**404.0**

* 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	Compras	Ventas	
3-14	3.0 %	3.1 %	2.8 %	2.9 %
15-35	3.0 %	3.1 %	2.8 %	3.0 %
36-60	2.9 %	3.2 %	2.8 %	2.9 %
61-90	-	3.0 %	2.7 %	2.9 %
91-180	2.6 %	3.1 %	2.4 %	3.0 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
Total	3.0 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %

*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	10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	364	7316	7455	34	107	3643	3690	29	124	5006	5320
Intragrupo y off-shore***	0	0	3906	3435	0	0	2266	1287	0	0	2675	1500
Otros	364	36	1353	1635	107	34	402	1333	124	29	666	1527
Total	**399**	**399**	**12575**	**12525**	**141**	**141**	**6311**	**6310**	**153**	**153**	**8347**	**8347**

* 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.