Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2020

Fecha de Información: 13 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$2812.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.[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	612.6	523.1	407.6	491.9	12.8	18.0	102.7
15-35	494.1	874.3	622.4	226.4	41.9	57.7	210.0
36-60	6.2	11.7	9.9	0.2	1.8	6.0	0.0
61-90	151.1	272.3	120.2	0.2	152.1	150.9	0.0
91-180	47.4	117.8	93.9	5.3	18.9	37.1	5.0
>180	13.4	5.7	0.0	12.2	5.7	1.1	0.0
Total	**1324.8**	**1804.9**	**1254.0**	**736.3**	**233.2**	**270.8**	**317.7**

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.8 %	2.3 %	1.7 %	2.1 %
15-35	2.8 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
36-60	-	3.0 %	2.4 %	2.6 %
61-90	-	2.8 %	2.7 %	2.8 %
91-180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.8 %
Total	2.8 %	2.7 %	2.3 %	2.6 %

*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**	37	148	7492	7491	34	328	3989	3964	29	123	5095	5529
Intragrupo y off-shore***	0	0	3939	3607	0	0	2446	1536	0	0	2870	1571
Otros	148	37	1348	1632	328	34	401	1335	123	29	681	1546
Total	**186**	**186**	**12780**	**12730**	**362**	**362**	**6836**	**6835**	**152**	**152**	**8646**	**8646**

* 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.