Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2020

Fecha de Información: 19 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$2668.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.[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	565.8	883.5	368.5	336.5	312.0	26.4	203.0
15-35	389.2	312.4	180.7	234.3	28.6	51.9	103.0
36-60	58.3	53.5	46.5	0.0	7.0	58.3	0.0
61-90	309.5	26.2	10.0	33.0	6.2	266.5	10.0
91-180	31.8	138.5	116.0	0.0	22.5	31.8	0.0
>180	84.3	156.3	121.3	0.0	10.0	59.3	25.0
Total	**1438.9**	**1570.5**	**843.1**	**603.8**	**386.5**	**494.1**	**341.0**

* 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 %	2.8 %	1.7 %	2.5 %
15-35	3.0 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %
36-60	-	3.0 %	2.7 %	2.8 %
61-90	2.8 %	3.0 %	2.7 %	2.7 %
91-180	-	2.7 %	2.6 %	2.7 %
>180	2.5 %	2.5 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.9 %	2.8 %	2.4 %	2.7 %

*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	17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	352	5029	5048	28	119	5296	5964	36	116	2602	3165
Intragrupo y off-shore***	0	0	2980	2334	0	0	3165	1628	1	0	2172	867
Otros	352	37	702	1327	119	28	719	1589	115	36	303	1045
Total	**389**	**389**	**8711**	**8710**	**147**	**147**	**9181**	**9181**	**153**	**153**	**5077**	**5077**

* 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.