Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2020

Fecha de Información: 20 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$2734.1 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	568.2	594.4	331.7	333.4	99.5	71.7	163.2
15-35	746.7	690.3	323.5	253.2	99.6	226.3	267.2
36-60	125.2	12.4	0.0	0.0	12.4	125.2	0.0
61-90	186.2	283.4	161.7	0.0	36.7	101.2	85.0
91-180	10.5	12.4	4.9	0.0	7.6	10.5	0.0
>180	4.9	14.9	10.0	0.0	4.9	4.9	0.0
Total	**1641.7**	**1607.7**	**831.8**	**586.6**	**260.6**	**539.8**	**515.4**

* 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	2.9 %	2.6 %	1.7 %	2.2 %
15-35	3.0 %	3.0 %	2.9 %	2.9 %
36-60	-	3.0 %	2.8 %	2.8 %
61-90	2.9 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
91-180	-	3.0 %	2.5 %	2.7 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.5 %
Total	2.9 %	2.9 %	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**	36	351	5275	5181	28	121	5481	6368	98	126	2701	3227
Intragrupo y off-shore***	0	0	2990	2545	0	0	3474	1711	1	0	2199	927
Otros	351	36	788	1326	121	28	721	1598	125	98	303	1048
Total	**387**	**387**	**9053**	**9052**	**149**	**149**	**9677**	**9677**	**223**	**223**	**5202**	**5202**

* 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.