Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2020

Fecha de Información: 21 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$1234.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.[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	231.6	322.5	207.6	143.1	54.9	28.5	60.0
15-35	329.5	442.7	218.5	99.8	23.2	28.7	201.0
36-60	47.8	31.9	0.0	0.0	31.9	47.8	0.0
61-90	18.0	1.7	0.0	9.0	1.7	9.0	0.0
91-180	22.3	39.1	25.0	0.0	9.1	17.3	5.0
>180	8.3	4.7	0.0	0.0	4.7	8.3	0.0
Total	**657.5**	**842.6**	**451.1**	**251.9**	**125.5**	**139.6**	**266.0**

* 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	2.9 %	3.1 %	2.3 %	2.8 %
15-35	2.9 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	3.1 %	2.8 %	2.9 %
61-90	-	3.3 %	2.6 %	2.7 %
91-180	2.6 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
>180	-	2.9 %	2.3 %	2.5 %
Total	2.9 %	3.0 %	2.6 %	2.8 %

*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	5183	26	124	5674	6578	108	169	2724	3295
Intragrupo y off-shore***	0	0	2990	2545	0	0	3615	1834	1	0	2265	947
Otros	351	36	789	1326	124	26	730	1608	168	108	304	1051
Total	**387**	**387**	**9055**	**9053**	**150**	**150**	**10019**	**10019**	**277**	**277**	**5293**	**5293**

* 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.