Fecha de Publicación: 1 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 28 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$1472.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.[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	380.8	276.8	108.7	225.0	21.1	8.8	147.0
15-35	357.8	454.6	208.9	170.4	131.8	73.4	114.0
36-60	49.8	56.1	0.0	8.7	56.1	41.1	0.0
61-90	43.7	56.3	0.0	0.0	16.3	3.7	40.0
91-180	5.9	33.9	0.0	0.0	33.9	5.9	0.0
>180	28.7	56.9	20.0	0.0	8.9	0.7	28.0
Total	**866.7**	**934.8**	**337.6**	**404.1**	**268.2**	**133.6**	**329.0**

* 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	2.4 %	2.6 %	1.4 %	1.9 %
15-35	2.5 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
36-60	-	2.8 %	2.5 %	2.6 %
61-90	2.5 %	2.8 %	2.2 %	2.5 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.7 %
>180	2.4 %	2.7 %	2.1 %	2.4 %
Total	2.4 %	2.6 %	1.9 %	2.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	163	6703	7488	133	208	3596	4264	17	71	5536	5858
Intragrupo y off-shore***	0	0	3821	2554	1	0	2905	1464	0	0	3389	1834
Otros	163	33	1144	1625	207	133	328	1102	71	17	427	1660
Total	**196**	**196**	**11667**	**11667**	**341**	**341**	**6830**	**6830**	**89**	**89**	**9352**	**9352**

* 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.

[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.