Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 07 de septiembre 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$400.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.[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	171.4	150.4	45.0	71.4	25.4	20.0	80.0
15-35	45.1	114.4	71.0	0.0	3.4	5.1	40.0
36-60	32.5	1.2	0.0	0.0	1.2	32.5	0.0
61-90	0.3	1.6	0.0	0.0	1.6	0.3	0.0
91-180	0.9	1.5	0.0	0.0	1.5	0.9	0.0
>180	0.0	1.1	0.0	0.0	1.1	0.0	0.0
Total	**250.3**	**270.3**	**116.0**	**71.4**	**34.3**	**58.9**	**120.0**

* 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 %	0.6 %	1.5 %	1.7 %
15-35	2.5 %	2.3 %	-3.3 %	2.1 %
36-60	-	3.1 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.9 %	2.2 %	2.8 %
91-180	-	2.7 %	1.6 %	2.3 %
>180	-	3.1 %	-	3.1 %
Total	2.4 %	1.9 %	1.3 %	1.9 %

*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	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	92	6786	7404	44	114	3674	4931	36	109	3626	3682
Intragrupo y off-shore***	0	0	4117	2547	0	0	3112	1416	0	0	2053	1060
Otros	92	17	752	1703	114	44	700	1139	109	36	439	1376
Total	**109**	**109**	**11654**	**11654**	**158**	**158**	**7486**	**7486**	**145**	**145**	**6118**	**6118**

* 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.