

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 18 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\$1228.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	353.7	178.2	141.1	314.5	10.1	12.2	27.0
15-35	173.2	437.3	390.2	62.7	19.1	82.6	28.0
36-60	2.2	3.1	0.0	0.0	3.1	2.2	0.0
61-90	22.7	13.4	2.0	20.0	11.4	2.7	0.0
91-180	20.4	20.0	0.0	20.0	20.0	0.4	0.0
>180	40.0	39.0	10.0	20.0	9.0	0.0	20.0
Total	612.2	690.9	543.2	437.2	72.7	100.0	75.0

* 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	2.3 %	2.0 %	1.3 %	1.5 %
15-35	2.4 %	2.2 %	2.3 %	2.2 %
36-60	-	2.7 %	2.2 %	2.5 %
61-90	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
91-180	-	2.3 %	2.4 %	2.4 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.3 %
Total	2.3 %	2.2 %	1.7 %	2.0 %

*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

Sector	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	136	5691	5938	40	111	4587	5040	29	86	4104	4812
Intragrupa y off-shore***	0	0	3557	3063	0	0	2841	1445	0	0	2655	931
Otros	136	42	944	1191	111	40	517	1459	86	29	810	1826
Total	177	177	10192	10192	152	152	7944	7944	115	115	7569	7569

* 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.