

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 21 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\$1686.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	346.2	452.4	342.7	225.0	2.7	14.2	107.0
15-35	393.2	282.2	209.8	179.7	36.4	177.5	36.0
36-60	39.9	189.6	187.8	29.1	1.8	10.9	0.0
61-90	21.6	25.7	10.0	2.1	15.7	19.5	0.0
91-180	60.7	37.0	0.0	30.0	12.0	5.7	25.0
>180	4.4	1.8	0.0	0.7	1.8	3.8	0.0
Total	866.0	988.7	750.2	466.5	70.5	231.5	168.0

* 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 %	2.1 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.3 %
61-90	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
91-180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.4 %	2.3 %	2.2 %	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

Sector	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	125	4776	5173	31	83	4251	5061	14	88	3989	4684
Intragruppo y off-shore***	0	0	2963	1611	0	0	2820	990	0	0	3133	1191
Otros	125	47	502	1456	83	31	812	1832	88	14	484	1731
Total	172	172	8241	8241	113	113	7883	7883	103	103	7606	7606

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.