

Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 22 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\$2033.9 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	239.9	313.0	195.8	127.1	28.3	23.8	89.0
15-35	710.8	610.8	375.5	223.5	26.6	278.6	208.7
36-60	120.0	92.7	43.8	40.0	9.0	40.0	40.0
61-90	21.3	24.5	3.0	0.0	21.5	21.3	0.0
91-180	111.2	188.3	90.0	15.2	8.3	6.0	90.0
>180	19.7	9.3	0.0	10.0	9.3	9.7	0.0
Total	1222.9	1238.7	708.0	415.7	103.0	379.4	427.7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %	2.4 %	1.9 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
91-180	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.2 %
>180	-	2.9 %	2.0 %	2.4 %
Total	2.3 %	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**	36	131	4925	5324	31	81	4301	5193	14	88	4028	4729
Intragruppo y off-shore***	0	0	3032	1707	0	0	2945	1022	0	0	3142	1191
Otros	131	36	524	1451	81	31	820	1851	88	14	484	1735
Total	167	167	8481	8481	112	112	8066	8066	102	102	7654	7654

* 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 intragruppo.