

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2624.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	330.3	221.7	129.0	258.0	30.7	10.3	62.0
15-35	969.8	967.8	392.1	279.0	150.2	265.2	425.6
36-60	51.0	50.9	0.0	0.0	50.9	51.0	0.0
61-90	91.3	253.4	143.7	10.0	39.7	11.3	70.0
91-180	44.7	8.3	0.0	3.3	8.3	41.4	0.0
>180	167.5	183.8	25.0	0.0	0.8	9.5	158.0
Total	1654.6	1685.9	689.8	550.3	280.5	388.7	715.6

* 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	2.2 %	2.3 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
36-60	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
61-90	3.2 %	2.3 %	2.1 %	2.5 %
91-180	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.2 %	1.9 %	2.2 %
Total	2.3 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %

*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**	39	141	5346	5665	32	87	4593	5325	16	88	4087	4867
Intragrupa y off-shore***	0	0	3146	2000	0	0	3025	1250	0	0	3238	1208
Otros	141	39	627	1454	87	32	840	1882	88	16	499	1749
Total	179	179	9119	9119	118	118	8457	8457	103	103	7824	7824

* 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.