Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 28 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$3824.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.[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	749.1	376.4	129.9	586.7	91.5	7.4	155.0
15-35	849.9	1267.0	610.7	231.8	297.0	258.9	359.3
36-60	122.9	155.8	105.0	6.5	40.8	106.4	10.0
61-90	151.1	22.0	10.5	149.3	11.5	1.8	0.0
91-180	105.0	26.1	10.0	70.3	16.1	34.7	0.0
>180	174.4	388.7	338.3	132.2	10.4	2.1	40.0
Total	**2152.4**	**2236.0**	**1204.4**	**1176.9**	**467.3**	**411.3**	**564.3**

* 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	2.1 %	2.4 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.1 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	2.2 %
91-180	-	2.3 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
Total	2.2 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %

*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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	50	129	5762	6209	19	82	4255	4968	31	98	3735	3914
Intragrupo y off-shore***	3	0	3369	2246	0	0	3316	1366	0	0	2282	607
Otros	126	50	1209	1885	82	19	517	1754	98	31	737	2233
Total	**179**	**179**	**10340**	**10340**	**101**	**101**	**8088**	**8088**	**129**	**129**	**6754**	**6754**

* 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.