

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 09 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\$1851.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	552.3	191.3	97.0	460.6	21.3	18.7	73.0
15-35	601.4	520.7	302.7	156.8	37.5	264.2	180.5
36-60	48.7	6.9	0.9	0.0	5.9	48.7	0.0
61-90	12.0	3.3	0.0	0.0	3.3	12.0	0.0
91-180	23.6	147.2	133.0	0.0	4.2	13.6	10.0
>180	3.2	4.2	0.0	0.6	4.2	2.6	0.0
Total	1241.1	873.6	533.6	618.0	76.5	359.7	263.5

* 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	
3-14	2.1 %	2.6 %	2.3 %	2.3 %
15-35	2.5 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.8 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-	2.7 %	2.3 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
Total	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %

*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	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	136	7679	7848	42	123	3989	5026	38	106	3708	3753
Intragrupo y off-shore***	0	0	4197	3335	0	0	3190	1716	0	0	2068	1066
Otros	136	27	1014	1707	123	42	717	1154	106	38	456	1413
Total	163	163	12890	12890	165	165	7896	7896	144	144	6232	6232

* 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.