

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2865.7 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	691.2	575.0	396.9	532.7	33.1	13.5	145.0
15-35	680.8	955.0	552.6	117.1	263.8	425.0	138.7
36-60	5.3	52.3	41.0	0.0	11.2	5.3	0.0
61-90	20.6	23.9	0.0	0.7	13.2	9.2	10.7
91-180	32.6	90.0	67.9	20.0	22.1	12.6	0.0
>180	7.4	31.0	20.0	0.0	6.0	2.4	5.0
Total	1438.0	1727.1	1078.4	670.5	349.3	468.0	299.4

* 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 %	2.5 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	3.2 %	2.1 %	2.8 %
61-90	2.2 %	2.6 %	2.1 %	2.3 %
91-180	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.2 %	2.4 %	2.1 %	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	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**	30	142	7962	7845	39	120	4240	5143	38	108	3871	4211
Intragrupa y off-shore***	0	0	4197	3614	0	0	3252	1920	0	0	2403	1117
Otros	142	30	1011	1711	120	39	730	1159	108	38	476	1422
Total	172	172	13170	13170	158	158	8222	8222	146	146	6750	6750

* 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.