

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 11 de septiembre de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1692.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	220.8	213.3	94.5	167.0	70.8	5.8	48.0
15-35	493.8	678.4	501.0	105.6	32.4	243.3	145.0
36-60	2.2	38.5	30.0	0.0	8.5	2.2	0.0
61-90	20.8	53.0	40.0	0.0	3.0	10.8	10.0
91-180	6.4	26.1	10.0	0.0	11.1	1.4	5.0
>180	50.0	102.0	64.8	44.4	32.2	0.5	5.0
Total	794.0	1111.2	740.3	317.0	157.9	264.0	213.0

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

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**	30	142	7962	7845	39	123	4447	5266	38	109	3884	4297
Intragrupo y off-shore***	0	0	4197	3614	0	0	3271	2087	0	0	2478	1117
Otros	142	30	1011	1711	123	39	796	1161	109	38	477	1425
Total	172	172	13170	13170	162	162	8514	8514	147	147	6839	6839

* 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.