

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 14 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\$1781.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	464.3	530.8	378.9	319.9	36.0	28.5	115.9
15-35	276.7	451.0	273.2	76.3	52.4	74.9	125.5
36-60	34.6	105.3	64.7	0.0	30.6	24.6	10.0
61-90	1.4	44.5	0.0	0.0	44.5	1.4	0.0
91-180	30.5	80.2	40.0	0.0	30.2	20.5	10.0
>180	0.8	22.8	15.0	0.0	7.8	0.8	0.0
Total	808.3	1234.6	771.8	396.2	201.5	150.7	261.4

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.3 %	2.1 %	2.3 %
36-60	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
61-90	-	2.6 %	2.3 %	2.6 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
>180	-	2.5 %	2.0 %	2.5 %
Total	2.3 %	2.4 %	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

Sectores	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	121	4874	5614	38	108	3915	4465	24	93	3800	4227
Intragruppo y off-shore***	0	0	3510	2405	0	0	2618	1119	0	0	2356	876
Otros	121	45	815	1180	108	38	479	1428	93	24	746	1798
Total	166	166	9198	9198	146	146	7012	7012	117	117	6901	6901

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.