

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 15 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\$2132.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	648.5	416.6	89.2	350.2	41.7	12.5	285.7
15-35	406.7	751.0	560.3	97.5	73.7	192.2	117.0
36-60	19.3	39.1	18.9	0.0	5.1	4.3	15.0
61-90	71.7	45.0	7.8	0.0	37.2	71.7	0.0
91-180	31.5	37.5	20.0	10.0	17.5	21.5	0.0
>180	30.9	57.8	40.0	0.0	12.8	25.9	5.0
Total	1208.5	1346.9	736.2	457.7	188.0	328.1	422.7

* 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	2.4 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.5 %	2.8 %	2.0 %	2.5 %
61-90	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.3 %
Total	2.4 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %

*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**	38	131	5338	5745	38	109	4065	4687	26	89	3848	4375
Intragrupo y off-shore***	0	0	3524	2753	0	0	2693	1121	0	0	2426	876
Otros	131	38	813	1177	109	38	488	1438	89	26	779	1802
Total	170	170	9675	9675	147	147	7246	7246	116	116	7052	7052

* 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 intragrupo.