

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 23 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\$1906.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	403.1	376.5	160.5	265.3	111.2	33.1	104.7
15-35	421.7	609.2	445.1	43.6	30.3	244.3	133.8
36-60	29.6	5.1	0.5	0.7	4.5	28.9	0.0
61-90	158.8	46.2	35.4	1.0	10.8	157.8	0.0
91-180	27.8	6.9	0.0	7.9	6.9	19.9	0.0
>180	48.3	11.9	0.0	10.2	11.9	38.1	0.0
Total	1089.2	1055.7	641.5	328.7	175.7	522.1	238.5

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	2.4 %	1.9 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
36-60	-	2.4 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.4 %	2.1 %	2.2 %
91-180	-	2.4 %	2.1 %	2.2 %
>180	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
Total	2.4 %	2.4 %	2.1 %	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	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	136	5151	5604	31	88	4470	5281	15	88	4075	4747
Intragruo y off-shore***	0	0	3133	1848	0	0	3005	1144	0	0	3142	1208
Otros	136	39	621	1453	88	31	826	1875	88	15	485	1747
Total	176	176	8905	8905	119	119	8300	8300	103	103	7701	7701

* 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 intragruo.