

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2020

Fecha de Información: 29 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\$3427.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	480.0	315.5	184.5	351.8	6.9	4.1	124.2
15-35	1258.3	786.9	438.2	585.0	234.7	559.3	114.0
36-60	89.1	355.9	300.0	0.6	15.9	48.4	40.0
61-90	35.2	46.3	0.0	0.0	46.3	35.2	0.0
91-180	40.6	241.8	230.0	10.0	11.8	30.6	0.0
>180	49.3	12.2	4.0	35.0	2.2	8.3	6.0
Total	1952.5	1758.7	1156.7	982.4	317.8	685.9	284.2

* 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	2.1 %	1.6 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.3 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.7 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %

* 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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	139	6006	6279	22	80	4489	5133	31	98	3802	4030
Intragrupo y off-shore***	3	0	3374	2427	0	0	3416	1537	0	0	2363	607
Otros	136	46	1208	1882	80	22	525	1760	98	31	739	2267
Total	185	185	10588	10588	103	103	8429	8429	129	129	6904	6904

* 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.