

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2020

Fecha de Información: 01 de octubre 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\$2622.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	554.2	457.5	249.5	400.7	101.3	46.8	106.7
15-35	620.3	755.0	569.8	313.6	30.2	151.7	155.0
36-60	10.3	31.5	25.0	0.0	6.5	10.3	0.0
61-90	151.7	232.2	140.0	10.0	2.2	51.7	90.0
91-180	105.1	43.7	25.0	0.0	8.7	95.1	10.0
>180	21.4	11.3	0.0	0.8	1.3	10.6	10.0
Total	1462.8	1531.2	1009.3	725.0	150.2	366.1	371.7

* 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	1.7 %	1.4 %	1.5 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.8 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.7 %
>180	2.1 %	2.5 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %

* 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**	48	147	6276	6368	22	82	5632	5473	31	99	3974	4377
Intragrupo y off-shore***	3	0	3396	2684	0	0	3615	2493	0	0	2626	708
Otros	144	48	1265	1885	82	22	537	1818	99	31	784	2299
Total	194	194	10938	10938	105	105	9785	9785	131	131	7385	7385

* 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.