

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2020

Fecha de Información: 02 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\$1966.4 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	283.3	379.6	236.9	199.5	67.6	8.7	75.1
15-35	408.7	556.0	349.3	199.4	56.2	58.8	150.5
36-60	31.8	82.8	70.0	0.0	6.2	25.2	6.6
61-90	39.1	36.5	20.0	0.0	1.5	24.1	15.0
91-180	227.7	196.4	145.0	46.3	7.4	137.5	44.0
>180	13.8	7.4	0.0	0.8	1.9	7.6	5.5
Total	1004.4	1258.8	821.2	445.9	140.8	261.7	296.8

* 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	
3-14	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.2 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.7 %	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	6278	6371	22	89	5887	5676	32	100	4001	4549
Intragrupo y off-shore***	3	0	3396	2685	0	0	3702	2691	0	0	2777	710
Otros	144	48	1268	1886	89	22	596	1816	100	32	788	2307
Total	194	194	10942	10942	111	111	10184	10184	132	132	7566	7566

* 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 intragrupo.