

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2020

Fecha de Información: 05 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\$2818.1 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	505.1	576.1	341.6	291.0	63.5	43.2	170.9
15-35	1056.1	722.1	359.5	336.9	209.1	565.7	153.5
36-60	5.1	36.3	20.0	0.0	16.3	5.1	0.0
61-90	1.4	5.2	0.0	0.0	5.2	1.4	0.0
91-180	78.0	65.5	50.0	12.5	5.5	55.5	10.0
>180	90.4	81.2	10.0	20.0	1.2	0.4	70.0
Total	1736.1	1486.3	781.1	660.4	300.8	671.4	404.4

* 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 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.9 %
61-90	-	2.4 %	1.7 %	2.3 %
91-180	1.8 %	1.8 %	1.9 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.8 %	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	5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	93	6221	6108	32	97	4140	4670	38	105	4907	5037
Intragrupo y off-shore***	0	0	3991	2906	0	0	2829	786	0	0	3091	1297
Otros	93	33	645	1844	97	32	799	2312	105	38	980	2644
Total	126	126	10858	10858	129	129	7768	7768	143	143	8978	8978

* 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.