

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2020

Fecha de Información: 06 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\$2058.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	308.3	339.3	110.3	183.0	108.0	4.3	121.0
15-35	711.7	610.0	328.7	220.8	17.4	227.0	264.0
36-60	82.4	114.8	60.0	9.8	14.8	32.6	40.0
61-90	1.2	28.6	0.0	0.0	28.6	1.2	0.0
91-180	155.8	102.3	40.0	0.0	7.3	100.8	55.0
>180	72.9	81.4	10.0	0.0	1.4	2.9	70.0
Total	1332.3	1276.4	549.0	413.6	177.5	368.7	550.0

* 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	1.9 %	0.8 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.9 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.8 %
91-180	1.9 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.0 %	2.1 %	2.0 %
Total	1.9 %	1.6 %	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	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**	35	101	6495	6325	32	110	4142	4764	38	105	4981	5120
Intragruppo y off-shore***	0	0	4091	3059	0	0	2829	786	0	0	3133	1327
Otros	101	35	641	1844	110	32	893	2314	105	38	980	2647
Total	137	137	11228	11228	142	142	7864	7864	143	143	9094	9094

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.