

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2020

Fecha de Información: 07 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\$1835.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	313.8	98.5	23.3	222.2	19.5	35.9	55.7
15-35	682.2	596.3	319.8	298.2	39.0	146.5	237.5
36-60	26.9	207.5	180.8	5.3	6.7	1.6	20.0
61-90	5.8	3.6	2.5	0.0	1.1	5.8	0.0
91-180	57.5	48.6	7.3	10.0	26.3	32.5	15.0
>180	57.0	95.9	65.0	25.0	0.9	2.0	30.0
Total	1143.1	1050.3	598.7	560.7	93.4	224.2	358.2

* 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 intragruo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %		2.3 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.9 %		1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.9 %		2.0 %	1.3 %	2.0 %
61-90	-		2.1 %	1.7 %	1.7 %
91-180	1.9 %		2.1 %	1.8 %	1.9 %
>180	2.2 %		2.1 %	2.1 %	2.1 %
Total	1.9 %		2.0 %	1.7 %	1.9 %

*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**	40	107	6709	6399	33	115	4227	4786	38	100	5004	5141
Intragruo y off-shore***	0	0	4112	3236	0	0	2834	828	0	0	3133	1331
Otros	107	40	662	1848	115	33	897	2343	100	38	982	2647
Total	147	147	11483	11483	148	148	7957	7957	138	138	9119	9119

* 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 intragruo.