

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2020

Fecha de Información: 08 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\$2033.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292.3	542.4	126.5	152.8	294.5	18.0	121.5
15-35	405.3	494.1	263.8	103.9	40.3	111.4	190.0
36-60	16.4	49.2	30.0	0.0	19.2	16.4	0.0
61-90	66.1	95.8	28.0	0.0	2.8	1.1	65.0
91-180	355.7	54.7	0.0	8.5	4.7	297.2	50.0
>180	81.5	26.1	0.0	40.0	6.1	21.5	20.0
Total	1217.4	1262.3	448.3	305.2	367.5	465.7	446.5

* 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 intragrupa		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	0.7 %	1.7 %	1.2 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
91-180	1.9 %	2.3 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.1 %	2.4 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.9 %	1.3 %	1.8 %	1.6 %

* 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**	44	127	6832	6459	33	116	4375	5170	38	100	5029	5239
Intragrupa y off-shore***	0	0	4128	3316	0	0	2849	893	0	0	3228	1339
Otros	127	44	662	1848	116	33	1187	2348	100	38	985	2664
Total	171	171	11623	11623	149	149	8411	8411	138	138	9242	9242

* 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 intragrupa.