

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2020

Fecha de Información: 13 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\$3232.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	820.6	652.0	182.9	748.3	407.1	10.4	62.0
15-35	351.7	820.4	736.3	145.1	32.7	155.1	51.5
36-60	469.4	89.7	30.0	0.0	9.7	419.4	50.0
61-90	3.7	2.5	1.4	2.4	1.1	1.3	0.0
91-180	35.3	77.6	50.0	0.0	17.6	25.3	10.0
>180	55.8	54.0	26.0	0.0	1.0	28.8	27.0
Total	1736.6	1696.2	1026.5	895.7	469.2	640.3	200.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.2 %		2.1 %	1.8 %	1.9 %
15-35	2.1 %		2.1 %	1.6 %	2.0 %
36-60	2.0 %		2.1 %	1.9 %	1.9 %
61-90	-		2.6 %	1.7 %	2.1 %
91-180	2.0 %		2.3 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.1 %		2.4 %	2.0 %	2.2 %
Total	1.8 %		2.1 %	1.8 %	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	12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	112	5320	5506	42	102	5137	5767	46	119	5348	5948
Intragrupo y off-shore***	0	0	3019	1795	0	0	3322	1411	19	0	3587	1862
Otros	112	39	1324	2362	102	41	1387	2668	100	46	735	1859
Total	151	151	9663	9663	144	144	9846	9846	166	166	9669	9669

* 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.