

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2020

Fecha de Información: 14 de octubre de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3651.7 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	841.2	398.1	119.6	516.4	44.5	91.0	233.9
15-35	906.3	849.4	556.0	499.0	58.4	172.3	235.0
36-60	10.6	64.7	0.8	0.0	63.9	10.6	0.0
61-90	233.9	327.5	91.5	0.0	5.0	2.9	231.0
91-180	284.9	502.4	290.0	0.0	47.4	119.9	165.0
>180	50.3	72.4	41.0	0.0	6.4	25.3	25.0
Total	2327.2	2214.4	1098.9	1015.4	225.5	421.9	889.9

* 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	
3-14	1.9 %	1.7 %	1.9 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	2.1 %	1.8 %	2.0 %
61-90	2.0 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
91-180	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.6 %	2.3 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.9 %	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**	40	116	5650	5629	43	102	5496	5988	46	120	5513	5999
Intragrupo y off-shore***	0	0	3067	2051	0	0	3383	1562	19	0	3597	1981
Otros	116	40	1327	2365	102	43	1421	2750	101	46	738	1868
Total	156	156	10044	10044	145	145	10300	10300	166	166	9848	9848

* 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.