

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2020

Fecha de Información: 15 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\$4335.8 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	877.6	373.7	184.1	672.0	22.6	38.6	167.0
15-35	1113.8	1010.7	460.0	325.2	182.6	420.5	368.1
36-60	25.8	351.2	348.0	11.1	3.2	14.7	0.0
61-90	104.8	255.6	176.8	10.0	3.9	19.8	75.0
91-180	491.7	345.2	20.0	80.0	215.2	301.7	110.0
>180	57.6	63.2	45.0	0.0	3.2	42.6	15.0
Total	2671.4	2399.6	1233.9	1098.3	430.6	837.9	735.1

* 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 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	2.6 %	1.8 %	2.0 %
61-90	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.2 %	2.8 %	2.0 %	2.1 %
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**	45	128	5676	5642	41	102	6101	6198	49	119	5753	6150
Intragrupo y off-shore***	0	0	3071	2069	0	0	3507	2072	19	0	3653	2125
Otros	128	45	1327	2362	102	41	1426	2764	100	49	758	1888
Total	173	173	10073	10073	143	143	11034	11034	169	169	10163	10163

* 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.