

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2020

Fecha de Información: 16 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\$1792.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	317.3	188.0	102.0	232.3	10.0	9.0	76.0
15-35	434.1	619.6	472.1	181.5	31.5	136.6	116.0
36-60	2.4	21.1	11.7	0.0	9.4	2.4	0.0
61-90	75.3	116.3	15.2	0.0	26.1	0.3	75.0
91-180	84.5	111.4	30.0	0.0	6.4	9.5	75.0
>180	79.8	104.7	84.7	55.9	0.0	3.9	20.0
Total	993.4	1161.0	715.6	469.7	83.4	161.7	362.0

* 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	1.8 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.2 %	1.6 %	2.1 %
61-90	1.8 %	3.0 %	1.3 %	2.1 %
91-180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
>180	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %

* 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	129	5676	5643	43	107	6367	6244	51	118	5795	6222
Intragruppo y off-shore***	0	0	3071	2069	0	0	3510	2299	19	0	3686	2130
Otros	129	45	1328	2363	107	42	1426	2761	99	51	762	1892
Total	174	174	10075	10075	149	149	11304	11304	169	169	10243	10243

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.