

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2020

Fecha de Información: 19 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\$2644.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	579.6	419.3	59.5	486.8	283.3	16.3	76.5
15-35	493.1	760.6	575.9	151.2	15.7	172.9	169.0
36-60	326.3	48.8	1.4	10.0	17.4	286.3	30.0
61-90	0.4	4.1	0.0	0.0	4.1	0.4	0.0
91-180	85.7	189.2	100.0	2.2	9.2	3.5	80.0
>180	92.3	70.3	0.0	20.0	0.3	2.3	70.0
Total	1577.3	1492.2	736.8	670.2	330.0	481.6	425.5

* 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	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.8 %	2.7 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.9 %	1.7 %	2.8 %
91-180	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	2.2 %	2.1 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.7 %	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	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	110	6901	6351	56	119	5830	6534	23	76	3765	3983
Intragrupa y off-shore***	0	0	3553	2776	19	0	3702	2140	0	0	2438	1586
Otros	110	47	1430	2758	100	56	1042	1900	76	23	484	1118
Total	157	157	11885	11885	176	176	10575	10575	99	99	6688	6688

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