

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2020

Fecha de Información: 20 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\$2919.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	605.3	328.0	118.6	394.1	25.7	27.5	183.7
15-35	1079.5	664.8	185.5	256.3	338.3	682.2	141.0
36-60	74.0	114.2	50.0	0.0	24.2	34.0	40.0
61-90	6.2	22.8	0.0	0.0	22.8	6.2	0.0
91-180	70.4	258.6	184.4	35.0	39.2	0.4	35.0
>180	66.0	59.6	0.0	10.0	29.6	26.0	30.0
Total	1901.4	1448.0	538.5	695.4	479.9	776.3	429.6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
36-60	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.9 %	1.9 %	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	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**	51	115	7286	6543	51	120	6020	6636	24	77	3909	4111
Intragruppo y off-shore***	0	0	3609	3011	19	0	3765	2300	0	0	2453	1608
Otros	115	51	1430	2771	101	51	1059	1909	77	24	572	1216
Total	166	166	12325	12325	172	172	10845	10845	101	101	6935	6935

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