

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2020

Fecha de Información: 21 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\$2360.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	669.0	295.0	56.4	397.5	37.8	70.8	200.8
15-35	693.5	483.9	248.2	346.5	110.6	222.0	125.0
36-60	7.1	47.9	0.6	0.0	47.3	7.1	0.0
61-90	85.5	187.4	80.0	0.0	42.4	20.5	65.0
91-180	20.4	202.1	149.0	0.0	53.1	20.4	0.0
>180	35.9	44.4	20.0	0.0	3.4	14.9	21.0
Total	1511.2	1260.6	554.2	744.0	294.6	355.5	411.8

* 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 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.0 %	1.5 %	1.9 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %
91-180	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %

*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**	55	140	7466	6613	51	121	6436	6809	22	79	3985	4171
Intragrupo y off-shore***	0	0	3650	3165	19	0	3767	2522	0	0	2479	1629
Otros	140	55	1431	2770	102	51	1087	1958	79	22	576	1240
Total	195	195	12548	12548	172	172	11290	11290	101	101	7040	7040

* 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.