

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2020

Fecha de Información: 22 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\$2889.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	502.4	251.3	150.0	326.5	8.3	82.9	93.0
15-35	763.9	579.4	308.5	269.2	201.4	425.3	69.5
36-60	13.3	23.4	1.5	5.0	21.9	8.3	0.0
61-90	133.4	112.3	47.0	0.0	15.3	83.4	50.0
91-180	329.4	330.9	15.0	0.0	295.9	309.4	20.0
>180	57.9	65.3	20.0	0.0	4.3	16.9	41.0
Total	1800.4	1362.6	542.0	600.7	547.0	926.2	273.5

* 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	1.6 %	1.3 %	1.5 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.9 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.8 %	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**	65	145	7569	6707	48	122	6720	6963	85	80	4015	4171
Intragruppo y off-shore***	0	0	3724	3254	19	0	3843	2729	0	0	2479	1659
Otros	145	65	1431	2764	103	48	1091	1962	80	85	576	1241
Total	210	210	12725	12725	170	170	11655	11655	165	165	7071	7071

* 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.