

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2020

Fecha de Información: 26 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\$1634.8 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	381.8	470.2	182.3	62.0	4.9	36.8	283.0
15-35	503.5	411.1	203.9	216.8	49.1	128.6	158.1
36-60	36.6	26.5	0.0	0.0	1.5	11.6	25.0
61-90	17.4	29.9	0.0	7.3	29.9	10.1	0.0
91-180	70.5	70.3	0.0	0.0	7.8	8.0	62.5
>180	110.2	100.4	35.0	20.3	0.4	25.0	65.0
Total	1120.1	1108.3	421.2	306.4	93.5	220.1	593.6

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.6 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	1.6 %	2.1 %	1.3 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.7 %	1.8 %
91-180	1.7 %	2.0 %	1.7 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.7 %	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	26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	58	130	7277	7529	110	79	4227	4373	24	90	3603	3880
Intragruppo y off-shore***	19	0	4223	3063	0	0	2504	1676	0	0	2437	1555
Otros	111	58	1102	2011	79	110	576	1257	90	24	559	1163
Total	188	188	12603	12603	189	189	7307	7307	114	114	6598	6598

* 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.