

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2020

Fecha de Información: 27 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\$2225.6 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	436.5	71.9	43.7	338.4	1.3	71.2	26.9
15-35	725.8	814.9	374.0	203.7	299.1	380.2	141.9
36-60	63.2	41.4	0.0	0.8	4.0	25.1	37.4
61-90	24.9	7.8	0.0	0.0	7.8	24.9	0.0
91-180	56.0	91.5	27.0	0.0	44.5	36.0	20.0
>180	36.8	115.0	80.6	0.0	0.4	2.8	34.0
Total	1343.4	1142.5	525.3	542.9	357.0	540.3	260.2

* 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 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	2.0 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.1 %	1.8 %	2.0 %	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	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**	32	133	7656	7590	139	80	4266	4381	24	90	3640	3903
Intragrupo y off-shore***	19	0	4261	3390	0	0	2509	1687	0	0	2445	1564
Otros	114	32	1100	2037	80	139	578	1285	90	24	563	1180
Total	165	165	13017	13017	219	219	7353	7353	114	114	6648	6648

* 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 intragrupo.