

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2020

Fecha de Información: 28 de octubre de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2328.1 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	587.2	367.9	237.1	417.2	12.8	52.0	118.0
15-35	559.5	646.7	403.8	228.8	115.7	203.4	127.3
36-60	48.0	21.7	5.0	5.0	16.7	43.0	0.0
61-90	121.6	69.4	15.0	19.1	29.4	77.5	25.0
91-180	29.8	103.1	45.2	5.7	37.9	4.1	20.0
>180	61.7	41.8	0.0	20.2	1.8	1.5	40.0
Total	1407.8	1250.6	706.1	696.0	214.3	381.5	330.3

* 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	
3-14	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.0 %	1.4 %	1.6 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.5 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.7 %	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**	39	140	7909	7803	139	80	4566	4498	24	90	3668	3945
Intragrupo y off-shore***	19	0	4437	3605	0	0	2540	1889	0	0	2484	1564
Otros	121	39	1099	2036	80	139	585	1304	90	24	565	1208
Total	179	179	13445	13445	219	219	7691	7691	114	114	6717	6717

* 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.