

Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 30 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\$1506.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	177.5	131.8	87.2	136.1	9.6	6.4	35.0
15-35	393.1	664.5	465.1	162.5	62.9	94.1	136.5
36-60	77.4	74.0	15.0	0.0	14.0	32.4	45.0
61-90	63.1	16.9	0.0	0.0	16.9	63.1	0.0
91-180	20.7	55.6	30.0	0.0	10.6	5.7	15.0
>180	32.1	61.2	25.0	0.0	6.2	2.1	30.0
Total	763.9	1004.0	622.3	298.6	120.2	203.8	261.5

* 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	
3-14	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.0 %	-2.1 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %

*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**	44	145	7995	7927	137	78	4904	4644	29	89	3815	4064
Intragrupo y off-shore***	19	0	4476	3657	0	0	2637	2170	0	0	2501	1604
Otros	126	44	1146	2034	78	137	591	1318	89	29	571	1218
Total	190	190	13618	13618	215	215	8132	8132	118	118	6887	6887

* 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.