Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2020

Fecha de Información: 09 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$1395.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.[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	252.7	211.5	80.9	225.7	130.5	27.0	0.0
15-35	297.9	286.4	236.5	230.5	24.9	42.4	25.0
36-60	44.1	27.3	0.0	0.0	27.3	44.1	0.0
61-90	3.0	40.0	20.0	1.3	20.0	1.7	0.0
91-180	114.6	147.0	95.0	10.0	37.0	89.6	15.0
>180	10.3	0.6	0.0	10.0	0.6	0.3	0.0
Total	**722.6**	**712.8**	**432.4**	**477.5**	**240.4**	**205.1**	**40.0**

* 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 %	2.2 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
36-60	-	2.3 %	2.3 %	2.3 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %
Total	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %

*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	5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	127	6833	6459	33	116	4604	5379	39	103	5047	5239
Intragrupo y off-shore***	0	0	4128	3316	0	0	2930	1102	0	0	3228	1355
Otros	127	43	663	1849	116	33	1315	2367	103	39	986	2667
Total	**170**	**170**	**11624**	**11624**	**149**	**149**	**8849**	**8849**	**142**	**142**	**9261**	**9261**

* 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.