Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2020

Fecha de Información: 23 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$2249.2 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	419.0	301.3	221.9	288.6	9.1	60.0	70.3
15-35	705.7	762.3	392.9	246.7	233.9	323.5	135.5
36-60	9.6	5.9	0.0	0.0	5.9	9.6	0.0
61-90	20.2	43.6	11.0	0.0	12.6	0.2	20.0
91-180	86.4	60.3	30.0	60.0	10.3	6.4	20.0
>180	53.8	56.8	23.0	10.0	3.8	13.8	30.0
Total	**1294.7**	**1230.3**	**678.8**	**605.3**	**275.7**	**413.6**	**275.8**

* 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 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	2.0 %	1.4 %	1.6 %
61-90	1.6 %	2.0 %	0.9 %	1.8 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.0 %	2.7 %	2.3 %	2.3 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.5 %	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	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	141	7569	6712	52	125	7066	7241	108	80	4061	4192
Intragrupo y off-shore***	0	0	3724	3254	19	0	4065	3001	0	0	2479	1676
Otros	141	67	1437	2764	106	52	1101	1990	80	108	573	1245
Total	**209**	**209**	**12730**	**12730**	**177**	**177**	**12232**	**12232**	**188**	**188**	**7113**	**7113**

* 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.