Fecha de Publicación: 3 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 29 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$2192.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.[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	402.3	248.8	65.0	236.6	41.6	23.6	142.2
15-35	549.2	751.6	409.5	174.3	140.5	173.5	201.5
36-60	17.8	4.2	0.0	5.0	4.2	12.8	0.0
61-90	99.6	23.6	0.0	0.0	8.6	84.6	15.0
91-180	69.7	206.3	160.0	0.0	16.3	39.7	30.0
>180	196.5	81.5	10.0	100.0	1.5	26.5	70.0
Total	**1335.2**	**1316.1**	**644.6**	**515.8**	**212.8**	**360.7**	**458.7**

* 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 %	1.7 %	1.1 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
36-60	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %

*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**	45	146	7995	7926	140	84	4739	4540	25	89	3804	4034
Intragrupo y off-shore***	19	0	4476	3657	0	0	2566	2034	0	0	2484	1604
Otros	127	45	1145	2033	84	140	582	1314	89	25	568	1217
Total	**191**	**191**	**13616**	**13616**	**224**	**224**	**7887**	**7887**	**114**	**114**	**6856**	**6856**

* 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.