

Fecha de Publicación: 5 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 03 de noviembre 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\$1799.1 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	338.8	170.3	126.5	240.0	9.8	64.8	34.0
15-35	569.2	567.5	306.0	245.7	61.4	123.5	200.0
36-60	62.1	79.2	30.1	4.0	9.1	18.1	40.0
61-90	65.3	34.6	0.3	0.0	34.4	65.3	0.0
91-180	20.3	31.9	10.0	0.0	11.9	10.3	10.0
>180	47.1	121.8	90.0	0.0	6.8	22.1	25.0
Total	1102.9	1005.2	562.8	489.7	133.4	304.2	309.0

* 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	1.4 %	1.7 %	1.5 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.5 %	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	2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	138	82	5175	4779	33	90	3860	4092	31	113	4845	4644
Intragrupo y off-shore***	0	0	2738	2405	0	0	2525	1609	0	0	2336	1307
Otros	82	138	590	1320	90	33	574	1259	113	31	1167	2397
Total	221	221	8503	8503	123	123	6960	6960	144	144	8348	8348

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.