

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 04 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\$2093.1 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	507.1	350.0	112.8	271.7	9.8	8.0	227.5
15-35	601.5	557.7	361.1	232.5	32.3	204.7	164.4
36-60	4.1	7.1	0.5	0.0	6.6	4.1	0.0
61-90	268.9	27.5	0.0	105.0	17.5	153.9	10.0
91-180	40.1	148.3	100.0	0.0	8.3	0.1	40.0
>180	21.2	11.3	0.0	11.0	1.3	0.2	10.0
Total	1443.0	1102.0	574.4	620.2	75.8	370.9	451.9

* 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 %	1.2 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.1 %	1.3 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.0 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.2 %	1.9 %	1.9 %
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	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**	145	77	5449	4862	33	86	3988	4203	29	121	5008	4773
Intragrupo y off-shore***	0	0	2825	2623	0	0	2535	1636	0	0	2375	1334
Otros	77	145	533	1321	86	33	576	1259	121	29	1173	2449
Total	223	223	8806	8806	119	119	7098	7098	150	150	8556	8556

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