

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 05 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\$1923.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	341.6	196.1	48.4	209.5	25.7	10.1	122.0
15-35	701.3	611.0	252.0	293.3	68.8	117.9	290.1
36-60	20.3	28.0	0.0	10.0	28.0	10.3	0.0
61-90	179.6	77.1	0.0	30.6	72.1	144.0	5.0
91-180	26.3	143.8	82.5	1.0	41.2	5.3	20.0
>180	27.6	27.6	0.0	0.0	7.6	7.6	20.0
Total	1296.7	1083.4	382.9	544.4	243.4	295.2	457.1

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	2.6 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.6 %	1.9 %	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**	150	76	5474	4900	32	100	4211	4277	30	128	5107	4862
Intragruppo y off-shore***	0	0	2863	2645	0	0	2545	1797	0	0	2392	1361
Otros	76	150	532	1324	100	32	578	1260	128	30	1177	2452
Total	226	226	8868	8868	132	132	7334	7334	157	157	8675	8675

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