

Fecha de Publicación: 11 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 09 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\$3284.4 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	688.0	253.6	114.2	561.8	40.5	27.3	98.9
15-35	1130.0	873.2	480.5	626.7	71.0	181.6	321.7
36-60	58.9	91.7	15.0	50.0	76.7	8.9	0.0
61-90	40.5	66.2	0.0	0.0	66.2	40.5	0.0
91-180	106.9	366.9	144.4	60.0	187.4	11.9	35.0
>180	15.3	58.6	0.0	5.0	48.6	0.3	10.0
Total	2039.7	1710.3	754.2	1303.5	490.5	270.6	465.6

* 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 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.6 %	1.6 %
36-60	-	2.0 %	1.5 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.3 %	1.7 %
91-180	1.6 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.2 %
Total	1.6 %	1.8 %	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	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	114	5092	4591	34	132	5384	5078	29	173	5132	5591
Intragrupo y off-shore***	0	0	2710	2519	0	0	2394	1465	0	3	2957	1386
Otros	114	52	589	1281	132	34	1226	2460	173	26	1162	2274
Total	165	165	8390	8390	165	165	9003	9003	202	202	9250	9250

* 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.