

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2286.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	566.3	290.8	132.6	371.9	57.3	93.5	100.9
15-35	512.4	638.0	366.8	299.3	115.2	57.1	156.0
36-60	104.3	20.8	3.3	83.0	17.5	21.3	0.0
61-90	90.3	80.4	41.3	0.0	39.1	90.3	0.0
91-180	59.1	140.4	0.0	8.1	95.4	6.0	45.0
>180	60.7	64.2	0.0	20.0	24.2	0.7	40.0
Total	1393.1	1234.8	544.0	782.3	348.9	268.9	341.9

* 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	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.4 %	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

Sector	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**	55	113	5392	4663	34	135	5641	5247	29	177	5181	5680
Intragrupa y off-shore***	0	0	2785	2742	0	0	2422	1614	0	3	2989	1405
Otros	113	55	586	1358	135	34	1277	2479	177	26	1194	2279
Total	168	168	8763	8763	169	169	9340	9340	206	206	9364	9364

* 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.