

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 11 de noviembre de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1100.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	551.9	419.3	27.0	169.0	30.3	20.9	362.0
15-35	216.3	208.5	156.0	163.5	9.0	9.3	43.5
36-60	0.5	7.0	0.0	0.0	7.0	0.5	0.0
61-90	1.2	42.0	24.3	0.0	17.7	1.2	0.0
91-180	19.1	20.9	0.0	18.5	20.9	0.6	0.0
>180	2.3	16.5	5.0	0.0	11.5	2.3	0.0
Total	791.4	714.2	212.4	351.0	96.3	34.9	405.5

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.2 %	1.6 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	2.2 %	0.4 %	2.1 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	2.1 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.2 %	1.6 %	1.2 %	1.3 %

*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**	58	139	5515	4678	34	149	5884	5460	29	178	5392	5873
Intragruo y off-shore***	0	0	2804	2859	0	0	2430	1661	0	3	2989	1420
Otros	139	58	582	1364	149	34	1304	2497	178	26	1197	2286
Total	197	197	8901	8901	183	183	9618	9618	207	207	9579	9579

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