

Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 12 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\$3942.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	734.7	234.0	156.1	622.2	44.6	79.3	33.2
15-35	818.4	928.0	654.1	476.2	72.3	140.7	201.5
36-60	491.3	470.0	410.0	254.0	60.0	237.3	0.0
61-90	190.5	92.5	28.0	130.0	44.5	40.5	20.0
91-180	40.8	160.6	55.0	5.6	85.6	15.1	20.0
>180	48.9	17.6	0.0	0.0	7.6	38.9	10.0
Total	2324.5	1902.5	1303.2	1488.0	314.6	551.7	284.7

* 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	1.1 %	1.2 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.3 %	1.2 %	1.2 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.2 %	1.6 %	1.8 %
Total	1.2 %	1.4 %	1.3 %	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**	54	191	5575	4734	33	149	6244	5610	30	129	5728	5907
Intragrupa y off-shore***	0	0	2857	2882	0	0	2512	1959	0	3	3017	1740
Otros	191	54	582	1396	149	33	1342	2529	129	27	1203	2301
Total	245	245	9013	9013	182	182	10098	10098	158	158	9948	9948

* 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 intragrupo.