

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 17 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\$3261.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	514.9	532.2	134.0	293.2	228.7	52.2	169.5
15-35	755.0	624.7	420.8	240.7	18.4	328.8	185.5
36-60	91.3	21.8	0.0	0.0	6.8	76.3	15.0
61-90	368.4	180.7	0.0	0.0	180.7	368.4	0.0
91-180	201.9	154.0	10.0	30.5	44.0	71.4	100.0
>180	221.6	92.5	38.0	0.0	27.5	194.6	27.0
Total	2153.1	1605.9	602.8	564.4	506.1	1091.7	497.0

* 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	1.5 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	1.5 %	2.2 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.5 %	1.6 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %

* 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	16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	149	7030	6148	33	132	5865	6137	30	125	4234	4189
Intragruppo y off-shore***	0	0	2659	2541	0	3	3078	1770	0	0	2402	1778
Otros	149	47	1589	2589	132	30	1278	2314	125	30	435	1104
Total	195	195	11277	11277	165	165	10220	10220	154	154	7072	7072

* 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 intragruppo.