

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 18 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\$2931.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	744.5	370.0	89.5	440.8	58.2	81.4	222.3
15-35	816.4	934.4	523.2	388.8	30.3	46.7	380.9
36-60	147.2	172.4	25.0	0.0	37.4	37.2	110.0
61-90	56.2	24.0	0.0	0.0	24.0	56.2	0.0
91-180	85.9	359.7	231.0	0.0	43.7	0.9	85.0
>180	4.7	14.6	0.0	0.0	14.6	4.7	0.0
Total	1854.9	1875.1	868.7	829.6	208.2	227.1	798.2

* 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	
3-14	1.6 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.6 %	1.0 %	1.6 %
>180	-	1.9 %	1.7 %	1.9 %
Total	1.6 %	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**

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	152	7533	6260	40	132	5971	6265	30	125	4430	4348
Intragrupo y off-shore***	0	0	2720	2952	0	3	3083	1800	0	0	2435	1818
Otros	152	47	1589	2631	132	37	1330	2319	125	30	439	1138
Total	198	198	11842	11842	172	172	10384	10384	155	155	7304	7304

* 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 intragrupo.