

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 20 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\$2891.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	544.4	474.0	87.7	164.0	22.3	16.4	364.0
15-35	855.8	502.7	309.4	645.4	16.4	33.4	177.0
36-60	279.9	126.1	0.0	0.0	76.1	229.9	50.0
61-90	106.2	89.5	67.7	50.0	21.8	56.2	0.0
91-180	67.1	368.7	252.0	0.0	51.7	2.1	65.0
>180	41.6	101.0	80.0	30.0	11.0	1.6	10.0
Total	1895.0	1662.1	796.8	889.4	199.3	339.6	666.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.8 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.6 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.6 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.8 %	2.3 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %

*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**	52	156	7769	6320	46	134	6730	7481	36	123	4600	4530
Intragrupo y off-shore***	0	0	2753	3123	0	3	3202	1974	0	0	2520	1884
Otros	156	52	1589	2668	134	43	1853	2329	123	36	446	1152
Total	208	208	12111	12111	180	180	11784	11784	159	159	7566	7566

* 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.