

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 23 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\$3091.1 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	857.5	520.0	200.5	525.6	56.5	69.0	263.0
15-35	676.1	1021.1	560.9	69.5	91.9	238.3	368.3
36-60	111.8	24.7	0.0	0.0	14.7	101.8	10.0
61-90	131.0	65.8	38.6	50.0	27.2	81.0	0.0
91-180	106.3	201.0	50.0	0.0	66.0	21.3	85.0
>180	88.4	58.7	0.0	20.0	13.7	23.4	45.0
Total	1971.2	1891.1	850.0	665.1	269.8	534.9	771.3

* 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	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	1.6 %	2.2 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
Total	1.7 %	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	23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	50	146	7429	7852	42	122	4749	4673	23	170	3336	3380
Intragrupo y off-shore***	0	3	3399	2468	0	0	2523	1916	10	0	2062	1628
Otros	146	47	1858	2366	122	42	491	1174	160	23	445	819
Total	196	196	12685	12685	165	165	7763	7763	193	193	5844	5828

* 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.