

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 24 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\$4102.2 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	1005.2	632.6	90.5	770.4	363.4	56.2	178.6
15-35	677.0	1216.4	798.7	221.4	22.4	60.3	395.4
36-60	98.0	81.2	0.0	36.0	81.2	62.0	0.0
61-90	395.8	216.4	10.0	55.0	46.4	180.8	160.0
91-180	380.6	114.4	3.2	0.6	33.2	302.0	78.0
>180	72.3	44.2	19.0	25.3	5.2	27.0	20.0
Total	2628.9	2305.2	921.4	1108.7	551.9	688.2	832.0

* 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 %	1.1 %	1.7 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.6 %
>180	1.7 %	2.1 %	1.9 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.5 %	1.6 %	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**	57	158	8058	7896	43	120	5109	5252	23	171	3433	3462
Intragrupo y off-shore***	0	3	3436	3051	0	0	2577	2103	10	0	2082	1665
Otros	158	54	1862	2408	120	43	849	1180	161	23	449	821
Total	215	215	13355	13355	163	163	8536	8536	194	194	5964	5948

* 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.