

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 26 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\$1294.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	493.1	437.2	0.0	55.8	34.9	35.0	402.3
15-35	371.8	414.6	153.8	114.8	6.5	2.7	254.3
36-60	140.1	192.4	50.0	0.0	3.0	0.7	139.4
61-90	1.0	16.7	2.2	0.0	14.5	1.0	0.0
91-180	0.3	18.7	0.0	0.0	18.7	0.3	0.0
>180	0.7	3.5	0.0	0.0	3.5	0.7	0.0
Total	1007.2	1083.1	206.0	170.6	81.0	40.6	796.0

* 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	
3-14	1.7 %	2.3 %	2.4 %	1.8 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.8 %	-1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.8 %
>180	-	1.9 %	1.4 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.9 %	1.7 %

*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**	56	167	8328	7898	44	114	5476	5719	26	179	3880	3890
Intragrupo y off-shore***	0	3	3439	3254	0	0	2775	2269	10	0	2148	1746
Otros	167	53	1856	2471	114	44	942	1205	169	26	453	830
Total	223	223	13623	13623	158	158	9193	9193	206	206	6481	6465

* 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.