Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 13 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$1932.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.[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	444.7	246.5	73.5	330.3	103.0	44.4	70.0
15-35	499.7	560.6	299.9	214.4	90.9	115.4	169.9
36-60	2.8	11.6	0.0	0.0	11.6	2.8	0.0
61-90	102.5	38.1	2.5	23.5	25.6	69.0	10.0
91-180	40.6	115.3	50.0	35.5	65.3	5.1	0.0
>180	53.0	91.9	45.0	20.0	21.9	8.0	25.0
Total	**1143.1**	**1064.0**	**470.9**	**623.6**	**318.3**	**244.6**	**274.9**

* 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	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.5 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.7 %	1.0 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
Total	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %

*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	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	190	5576	4735	43	149	6635	5768	32	130	5760	5990
Intragrupo y off-shore***	0	0	2857	2882	0	0	2564	2275	0	3	3039	1755
Otros	190	55	582	1397	149	43	1398	2555	130	29	1246	2299
Total	**245**	**245**	**9014**	**9014**	**193**	**193**	**10598**	**10598**	**161**	**161**	**10044**	**10044**

* 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.