

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 27 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\$1716.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	419.3	230.7	68.6	232.2	88.9	113.9	73.2
15-35	414.7	365.3	191.9	228.0	68.0	81.2	105.5
36-60	55.1	76.0	30.0	11.5	41.0	38.6	5.0
61-90	119.5	121.6	5.0	0.0	49.6	52.5	67.0
91-180	1.3	27.9	0.0	0.0	27.9	1.3	0.0
>180	50.4	133.1	0.0	0.0	85.1	2.4	48.0
Total	1060.3	954.5	295.5	471.7	360.4	289.9	298.7

* 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 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	1.8 %	2.2 %	1.5 %	1.9 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.9 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.6 %	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

Sector	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	8349	7919	39	106	5790	5906	31	180	3986	3937
Intragrupa y off-shore***	0	3	3459	3274	0	0	2834	2430	10	0	2158	1817
Otros	167	53	1857	2471	106	39	1016	1304	170	31	471	845
Total	223	223	13664	13664	145	145	9640	9640	211	211	6615	6599

* 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.