

Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 30 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\$1417.5 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	268.8	190.3	90.8	172.9	29.5	25.9	70.0
15-35	331.0	276.4	161.0	203.7	43.4	55.3	72.0
36-60	78.4	33.3	10.0	11.0	23.3	67.4	0.0
61-90	90.0	74.1	0.0	30.0	16.1	2.0	58.0
91-180	91.0	141.5	33.2	68.2	108.3	22.8	0.0
>180	11.5	36.2	0.0	0.0	31.2	6.5	5.0
Total	870.8	751.7	295.0	485.8	251.8	180.0	205.0

* 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	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.3 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.5 %	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	30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	113	5947	6000	34	181	4089	4026	42	209	5263	5658
Intragrupa y off-shore***	0	0	2886	2536	10	0	2196	1882	0	0	3265	1956
Otros	113	46	1017	1314	171	34	493	854	209	42	455	1353
Total	159	159	9851	9851	215	215	6778	6762	250	250	8983	8967

* 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.