

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$2140.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	499.5	226.6	90.7	393.7	33.2	3.0	102.8
15-35	583.2	481.5	253.0	361.0	43.0	36.7	185.5
36-60	79.6	72.5	20.0	15.0	52.5	64.6	0.0
61-90	171.9	194.2	78.9	31.0	28.3	53.9	87.0
91-180	0.9	141.3	62.0	0.0	79.3	0.9	0.0
>180	5.6	63.4	0.0	0.0	58.4	0.6	5.0
Total	1340.6	1179.6	504.7	800.7	294.7	159.6	380.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.8 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.1 %	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**	53	128	6184	6095	34	183	4156	4114	42	208	5476	5720
Intragruppo y off-shore***	0	0	2930	2716	10	0	2238	1912	0	0	3300	2150
Otros	128	53	1014	1316	173	34	501	853	208	42	472	1363
Total	181	181	10127	10127	217	217	6895	6879	250	250	9248	9232

* 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 intragruppo.