

Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 03 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\$3011.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	535.9	417.2	84.8	324.1	223.4	102.8	109.0
15-35	714.8	451.6	219.3	466.3	32.3	48.5	200.0
36-60	281.8	508.9	435.4	80.1	43.6	171.7	30.0
61-90	87.5	51.3	0.0	10.0	51.3	77.5	0.0
91-180	62.1	70.3	0.0	27.5	64.6	28.8	5.7
>180	52.0	147.4	30.5	0.0	91.9	27.0	25.0
Total	1734.1	1646.9	770.0	908.0	507.1	456.3	369.8

* 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	1.3 %	1.3 %	2.2 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.3 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.8 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.7 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
Total	1.4 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %

*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**	62	135	6545	6365	40	190	4404	4426	41	215	6192	6102
Intragrupa y off-shore***	0	0	3156	2881	10	0	2252	2016	0	0	3422	2727
Otros	135	62	1028	1483	180	40	657	855	215	41	602	1370
Total	197	197	10729	10729	229	229	7313	7297	256	256	10216	10200

* 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.