

Fecha de Publicación: 9 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 04 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\$2743.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	208.8	546.0	157.0	156.0	354.1	17.9	34.9
15-35	616.4	429.6	375.3	410.5	16.3	167.9	38.0
36-60	198.7	56.0	33.0	0.0	23.0	198.7	0.0
61-90	225.6	80.8	46.0	70.0	24.8	145.6	10.0
91-180	197.6	74.2	0.0	26.9	39.2	135.7	35.0
>180	63.6	174.6	122.1	50.0	42.4	3.6	10.0
Total	1510.7	1361.1	733.4	713.4	499.8	669.4	127.9

* 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	1.3 %	1.1 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.1 %	1.3 %	1.1 %	1.1 %
36-60	-	1.4 %	0.9 %	1.0 %
61-90	1.3 %	1.8 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.3 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %

*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**	65	136	6593	6369	40	190	4549	4671	42	210	6250	6407
Intragrupa y off-shore***	0	0	3156	2881	10	0	2382	2135	0	0	3449	2764
Otros	136	65	1032	1531	180	40	755	865	210	42	862	1373
Total	200	200	10781	10781	230	230	7686	7670	252	252	10561	10545

* 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.