

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2020

Fecha de Información: 30 de septiembre de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3455.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|--------------------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1010.6 | 231.2 | 159.8 | 913.8 | 9.4 | 34.8 | 62.0 |
| 15-35 | 617.4 | 1200.9 | 919.8 | 268.8 | 187.2 | 254.6 | 94.0 |
| 36-60 | 4.1 | 99.0 | 72.0 | 0.0 | 27.0 | 4.1 | 0.0 |
| 61-90 | 112.8 | 102.3 | 70.0 | 95.0 | 17.3 | 2.8 | 15.0 |
| 91-180 | 25.2 | 16.4 | 0.0 | 0.0 | 16.4 | 25.2 | 0.0 |
| >180 | 94.4 | 134.1 | 110.0 | 61.1 | 2.6 | 11.8 | 21.5 |
| Total | 1864.5 | 1783.9 | 1331.6 | 1338.7 | 259.9 | 333.3 | 192.5 |

* 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 intragruo | | Total |
|--------------|--------------------|--------|-----------------------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.9 % | | 1.9 % | 2.0 % | 2.0 % |
| 15-35 | 2.0 % | | 2.0 % | 1.9 % | 2.0 % |
| 36-60 | - | | 2.0 % | 1.5 % | 2.0 % |
| 61-90 | 1.9 % | | 2.1 % | 1.9 % | 2.0 % |
| 91-180 | - | | 2.3 % | 1.8 % | 2.0 % |
| >180 | 2.1 % | | 2.0 % | 1.6 % | 1.9 % |
| Total | 2.0 % | | 2.0 % | 1.9 % | 2.0 % |

*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**

| Sectores | 28 de sep. al 2 de octubre | | | | 5 al 9 de octubre | | | | 12 al 16 de octubre | | | |
|--------------------------|----------------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 47 | 141 | 6233 | 6309 | 22 | 82 | 5255 | 5213 | 32 | 99 | 3836 | 4156 |
| Intragruo y off-shore*** | 3 | 0 | 3392 | 2643 | 0 | 0 | 3447 | 2234 | 0 | 0 | 2473 | 608 |
| Otros | 138 | 47 | 1210 | 1883 | 82 | 22 | 531 | 1787 | 99 | 32 | 740 | 2285 |
| Total | 189 | 189 | 10835 | 10835 | 104 | 104 | 9234 | 9234 | 131 | 131 | 7049 | 7049 |

* 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 intragruo.