

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2020

Fecha de Información: 14 de octubre 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\$3651.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 841.2 | 398.1 | 119.6 | 516.4 | 44.5 | 91.0 | 233.9 |
| 15-35 | 906.3 | 849.4 | 556.0 | 499.0 | 58.4 | 172.3 | 235.0 |
| 36-60 | 10.6 | 64.7 | 0.8 | 0.0 | 63.9 | 10.6 | 0.0 |
| 61-90 | 233.9 | 327.5 | 91.5 | 0.0 | 5.0 | 2.9 | 231.0 |
| 91-180 | 284.9 | 502.4 | 290.0 | 0.0 | 47.4 | 119.9 | 165.0 |
| >180 | 50.3 | 72.4 | 41.0 | 0.0 | 6.4 | 25.3 | 25.0 |
| Total | 2327.2 | 2214.4 | 1098.9 | 1015.4 | 225.5 | 421.9 | 889.9 |

* 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 | 1.9 % | 1.7 % | 1.9 % | 1.9 % |
| 15-35 | 1.9 % | 2.0 % | 1.9 % | 1.9 % |
| 36-60 | - | 2.1 % | 1.8 % | 2.0 % |
| 61-90 | 2.0 % | 1.9 % | 1.8 % | 1.9 % |
| 91-180 | 2.0 % | 2.0 % | 2.0 % | 2.0 % |
| >180 | 2.0 % | 2.3 % | 2.6 % | 2.3 % |
| Total | 1.9 % | 2.0 % | 1.9 % | 1.9 % |

* 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 | 12 al 16 de octubre | | | | 19 al 23 de octubre | | | | 26 al 30 de octubre | | | |
|----------------------------------|---------------------|------------|--------------|--------------|---------------------|------------|--------------|--------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 40 | 116 | 5650 | 5629 | 43 | 102 | 5496 | 5988 | 46 | 120 | 5513 | 5999 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 3067 | 2051 | 0 | 0 | 3383 | 1562 | 19 | 0 | 3597 | 1981 |
| Otros | 116 | 40 | 1327 | 2365 | 102 | 43 | 1421 | 2750 | 101 | 46 | 738 | 1868 |
| Total | 156 | 156 | 10044 | 10044 | 145 | 145 | 10300 | 10300 | 166 | 166 | 9848 | 9848 |

* 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.