

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2020

Fecha de Información: 21 de octubre 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\$2360.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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 | 669.0 | 295.0 | 56.4 | 397.5 | 37.8 | 70.8 | 200.8 |
| 15-35 | 693.5 | 483.9 | 248.2 | 346.5 | 110.6 | 222.0 | 125.0 |
| 36-60 | 7.1 | 47.9 | 0.6 | 0.0 | 47.3 | 7.1 | 0.0 |
| 61-90 | 85.5 | 187.4 | 80.0 | 0.0 | 42.4 | 20.5 | 65.0 |
| 91-180 | 20.4 | 202.1 | 149.0 | 0.0 | 53.1 | 20.4 | 0.0 |
| >180 | 35.9 | 44.4 | 20.0 | 0.0 | 3.4 | 14.9 | 21.0 |
| Total | 1511.2 | 1260.6 | 554.2 | 744.0 | 294.6 | 355.5 | 411.8 |

* 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 | |
| 3-14 | 1.8 % | 1.8 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 15-35 | 1.7 % | 1.9 % | 1.7 % | 1.8 % |
| 36-60 | - | 2.0 % | 1.5 % | 1.9 % |
| 61-90 | 1.6 % | 1.8 % | 1.6 % | 1.8 % |
| 91-180 | - | 1.8 % | 1.7 % | 1.8 % |
| >180 | 2.1 % | 2.1 % | 2.0 % | 2.1 % |
| Total | 1.7 % | 1.9 % | 1.6 % | 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

| Sectores | 19 al 23 de octubre | | | | 26 al 30 de octubre | | | | 2 al 6 de noviembre | | | |
|----------------------------------|---------------------|------------|--------------|--------------|---------------------|------------|--------------|--------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 55 | 140 | 7466 | 6613 | 51 | 121 | 6436 | 6809 | 22 | 79 | 3985 | 4171 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 3650 | 3165 | 19 | 0 | 3767 | 2522 | 0 | 0 | 2479 | 1629 |
| Otros | 140 | 55 | 1431 | 2770 | 102 | 51 | 1087 | 1958 | 79 | 22 | 576 | 1240 |
| Total | 195 | 195 | 12548 | 12548 | 172 | 172 | 11290 | 11290 | 101 | 101 | 7040 | 7040 |

* 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.