

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 05 de noviembre 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\$1923.1 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 | 341.6 | 196.1 | 48.4 | 209.5 | 25.7 | 10.1 | 122.0 |
| 15-35 | 701.3 | 611.0 | 252.0 | 293.3 | 68.8 | 117.9 | 290.1 |
| 36-60 | 20.3 | 28.0 | 0.0 | 10.0 | 28.0 | 10.3 | 0.0 |
| 61-90 | 179.6 | 77.1 | 0.0 | 30.6 | 72.1 | 144.0 | 5.0 |
| 91-180 | 26.3 | 143.8 | 82.5 | 1.0 | 41.2 | 5.3 | 20.0 |
| >180 | 27.6 | 27.6 | 0.0 | 0.0 | 7.6 | 7.6 | 20.0 |
| Total | 1296.7 | 1083.4 | 382.9 | 544.4 | 243.4 | 295.2 | 457.1 |

* 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 | 1.6 % | | 2.6 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 15-35 | 1.6 % | | 1.8 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 36-60 | - | | 2.1 % | 1.6 % | 1.9 % |
| 61-90 | 1.7 % | | 1.8 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 91-180 | 1.6 % | | 1.8 % | 1.7 % | 1.8 % |
| >180 | 2.0 % | | 2.1 % | 1.8 % | 2.0 % |
| Total | 1.6 % | | 1.9 % | 1.5 % | 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 | 2 al 6 de noviembre | | | | 9 al 13 de noviembre | | | | 16 al 20 de noviembre | | | |
|---------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 150 | 76 | 5474 | 4900 | 32 | 100 | 4211 | 4277 | 30 | 128 | 5107 | 4862 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2863 | 2645 | 0 | 0 | 2545 | 1797 | 0 | 0 | 2392 | 1361 |
| Otros | 76 | 150 | 532 | 1324 | 100 | 32 | 578 | 1260 | 128 | 30 | 1177 | 2452 |
| Total | 226 | 226 | 8868 | 8868 | 132 | 132 | 7334 | 7334 | 157 | 157 | 8675 | 8675 |

* 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.