

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2286.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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 | 566.3 | 290.8 | 132.6 | 371.9 | 57.3 | 93.5 | 100.9 |
| 15-35 | 512.4 | 638.0 | 366.8 | 299.3 | 115.2 | 57.1 | 156.0 |
| 36-60 | 104.3 | 20.8 | 3.3 | 83.0 | 17.5 | 21.3 | 0.0 |
| 61-90 | 90.3 | 80.4 | 41.3 | 0.0 | 39.1 | 90.3 | 0.0 |
| 91-180 | 59.1 | 140.4 | 0.0 | 8.1 | 95.4 | 6.0 | 45.0 |
| >180 | 60.7 | 64.2 | 0.0 | 20.0 | 24.2 | 0.7 | 40.0 |
| Total | 1393.1 | 1234.8 | 544.0 | 782.3 | 348.9 | 268.9 | 341.9 |

* 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 intragruo | | Total |
|--------------|--------------------|-----------------------------|--------------|--------------|
| | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.5 % | 1.5 % | 1.3 % | 1.4 % |
| 15-35 | 1.4 % | 1.5 % | 1.4 % | 1.5 % |
| 36-60 | - | 2.1 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 61-90 | - | 2.0 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 91-180 | 1.6 % | 1.9 % | 1.6 % | 1.8 % |
| >180 | 1.8 % | 2.2 % | 1.7 % | 1.9 % |
| Total | 1.5 % | 1.6 % | 1.4 % | 1.5 % |

*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 | 9 al 13 de noviembre | | | | 16 al 20 de noviembre | | | | 23 al 27 de noviembre | | | |
|--------------------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 55 | 113 | 5392 | 4663 | 34 | 135 | 5641 | 5247 | 29 | 177 | 5181 | 5680 |
| Intragruo y off-shore*** | 0 | 0 | 2785 | 2742 | 0 | 0 | 2422 | 1614 | 0 | 3 | 2989 | 1405 |
| Otros | 113 | 55 | 586 | 1358 | 135 | 34 | 1277 | 2479 | 177 | 26 | 1194 | 2279 |
| Total | 168 | 168 | 8763 | 8763 | 169 | 169 | 9340 | 9340 | 206 | 206 | 9364 | 9364 |

* 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)¹ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.