

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 18 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1798 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.25%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | |
|--------------|--------------------------------|--------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Interbancarios |
| 3-14 | 292,0 | 92,2 | 55,9 | 213,1 | 26,3 | 68,9 | 10,0 |
| 15-35 | 413,4 | 519,8 | 414,4 | 358,4 | 70,8 | 20,5 | 34,5 |
| 36-60 | 25,1 | 52,8 | 23,0 | 0,0 | 6,8 | 2,1 | 23,0 |
| 61-90 | 7,4 | 136,7 | 115,0 | 0,0 | 21,7 | 7,4 | 0,0 |
| 91-180 | 8,6 | 29,2 | 10,0 | 0,0 | 17,2 | 6,6 | 2,0 |
| >180 | 194,8 | 118,4 | 78,1 | 170,1 | 17,4 | 1,7 | 23,0 |
| Total | 941,3 | 949,2 | 696,4 | 741,6 | 160,3 | 107,2 | 92,5 |

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Sector Financiero ^a | | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------------------|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 0.96% | | 1.19% | 0.99% | 1.04% |
| 15-35 | 0.93% | | 1.01% | 1.01% | 1.01% |
| 36-60 | 0.81% | | 1.08% | 1.00% | 0.96% |
| 61-90 | — | | 1.51% | 1.15% | 1.43% |
| 91-180 | 1.93% | | 1.91% | 1.58% | 1.83% |
| >180 | 2.05% | | 1.99% | 1.99% | 1.99% |
| Total | 1.20% | | 1.23% | 1.27% | 1.25% |

^a Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹Datos provisionales.

²El 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 14 - 18 dic. | | | | 21 - 25 dic. | | | | 28 dic. - 01 ene. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 15 | 45 | 725 | 582 | 23 | 135 | 4731 | 4734 | 15 | 129 | 2201 | 2646 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 296 | 437 | 0 | 0 | 2633 | 2803 | 0 | 0 | 1686 | 1371 |
| Otros ^c | 45 | 15 | 177 | 179 | 135 | 23 | 507 | 335 | 129 | 15 | 347 | 217 |
| Total | 60 | 60 | 1198 | 1198 | 158 | 158 | 7871 | 7872 | 144 | 144 | 4234 | 4234 |

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.