

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 23 de septiembre 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\$1906.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 403.1 | 376.5 | 160.5 | 265.3 | 111.2 | 33.1 | 104.7 |
| 15-35 | 421.7 | 609.2 | 445.1 | 43.6 | 30.3 | 244.3 | 133.8 |
| 36-60 | 29.6 | 5.1 | 0.5 | 0.7 | 4.5 | 28.9 | 0.0 |
| 61-90 | 158.8 | 46.2 | 35.4 | 1.0 | 10.8 | 157.8 | 0.0 |
| 91-180 | 27.8 | 6.9 | 0.0 | 7.9 | 6.9 | 19.9 | 0.0 |
| >180 | 48.3 | 11.9 | 0.0 | 10.2 | 11.9 | 38.1 | 0.0 |
| Total | 1089.2 | 1055.7 | 641.5 | 328.7 | 175.7 | 522.1 | 238.5 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2.4 % | 2.4 % | 1.9 % | 2.2 % |
| 15-35 | 2.3 % | 2.5 % | 2.2 % | 2.4 % |
| 36-60 | - | 2.4 % | 2.0 % | 2.0 % |
| 61-90 | - | 2.4 % | 2.1 % | 2.2 % |
| 91-180 | - | 2.4 % | 2.1 % | 2.2 % |
| >180 | - | 2.2 % | 2.1 % | 2.1 % |
| Total | 2.4 % | 2.4 % | 2.1 % | 2.3 % |

*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

| Sector | 21 al 25 de septiembre | | | | 28 de sep. al 2 de octubre | | | | 5 al 9 de octubre | | | |
|-----------------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 39 | 136 | 5151 | 5604 | 31 | 88 | 4470 | 5281 | 15 | 88 | 4075 | 4747 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 3133 | 1848 | 0 | 0 | 3005 | 1144 | 0 | 0 | 3142 | 1208 |
| Otros | 136 | 39 | 621 | 1453 | 88 | 31 | 826 | 1875 | 88 | 15 | 485 | 1747 |
| Total | 176 | 176 | 8905 | 8905 | 119 | 119 | 8300 | 8300 | 103 | 103 | 7701 | 7701 |

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.