

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 26 de noviembre 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\$1294.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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 | 493.1 | 437.2 | 0.0 | 55.8 | 34.9 | 35.0 | 402.3 |
| 15-35 | 371.8 | 414.6 | 153.8 | 114.8 | 6.5 | 2.7 | 254.3 |
| 36-60 | 140.1 | 192.4 | 50.0 | 0.0 | 3.0 | 0.7 | 139.4 |
| 61-90 | 1.0 | 16.7 | 2.2 | 0.0 | 14.5 | 1.0 | 0.0 |
| 91-180 | 0.3 | 18.7 | 0.0 | 0.0 | 18.7 | 0.3 | 0.0 |
| >180 | 0.7 | 3.5 | 0.0 | 0.0 | 3.5 | 0.7 | 0.0 |
| Total | 1007.2 | 1083.1 | 206.0 | 170.6 | 81.0 | 40.6 | 796.0 |

* 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 | 1.7 % | 2.3 % | 2.4 % | 1.8 % |
| 15-35 | 1.6 % | 1.7 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 36-60 | 1.6 % | 1.6 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 61-90 | - | 1.8 % | -1.6 % | 1.6 % |
| 91-180 | - | 1.9 % | 1.1 % | 1.8 % |
| >180 | - | 1.9 % | 1.4 % | 1.8 % |
| Total | 1.7 % | 1.8 % | 1.9 % | 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 | 23 al 27 de noviembre | | | | 30 de nov. al 4 de diciembre | | | | 7 al 11 de diciembre | | | |
|----------------------------|-----------------------|------------|--------------|--------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 56 | 167 | 8328 | 7898 | 44 | 114 | 5476 | 5719 | 26 | 179 | 3880 | 3890 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 3 | 3439 | 3254 | 0 | 0 | 2775 | 2269 | 10 | 0 | 2148 | 1746 |
| Otros | 167 | 53 | 1856 | 2471 | 114 | 44 | 942 | 1205 | 169 | 26 | 453 | 830 |
| Total | 223 | 223 | 13623 | 13623 | 158 | 158 | 9193 | 9193 | 206 | 206 | 6481 | 6465 |

* 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 intragruppo.