

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2020

Fecha de Información: 29 de enero 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\$1929.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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 | 391.9 | 370.4 | 154.5 | 145.5 | 6.9 | 37.4 | 209.0 |
| 15-35 | 583.4 | 510.0 | 250.3 | 204.6 | 92.4 | 211.3 | 167.4 |
| 36-60 | 84.5 | 93.1 | 30.0 | 12.5 | 58.1 | 67.0 | 5.0 |
| 61-90 | 83.7 | 73.8 | 50.0 | 0.0 | 8.8 | 68.7 | 15.0 |
| 91-180 | 32.7 | 49.1 | 0.0 | 5.0 | 48.1 | 26.7 | 1.0 |
| >180 | 20.5 | 33.7 | 29.0 | 13.3 | 4.7 | 7.2 | 0.0 |
| Total | 1196.7 | 1130.2 | 513.8 | 380.9 | 219.0 | 418.4 | 397.4 |

* 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 | 1.8 % | 1.5 % | 1.7 % | 1.7 % |
| 15-35 | 2.0 % | 1.9 % | 1.7 % | 1.8 % |
| 36-60 | 2.2 % | 2.3 % | 2.1 % | 2.2 % |
| 61-90 | 2.3 % | 2.4 % | 2.1 % | 2.2 % |
| 91-180 | 2.5 % | 2.5 % | 2.3 % | 2.5 % |
| >180 | - | 2.8 % | 2.4 % | 2.5 % |
| Total | 1.9 % | 1.9 % | 1.8 % | 1.9 % |

*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 | 27 al 31 de enero | | | | 3 al 7 de febrero | | | | 10 al 14 de febrero | | | |
|----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 21 | 170 | 4975 | 4543 | 28 | 108 | 3631 | 3212 | 37 | 177 | 3493 | 3811 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1668 | 1798 | 0 | 0 | 1284 | 1518 | 0 | 0 | 1989 | 1349 |
| Otros | 170 | 21 | 1323 | 1625 | 108 | 28 | 657 | 841 | 177 | 37 | 716 | 1038 |
| Total | 190 | 190 | 7966 | 7966 | 135 | 135 | 5572 | 5572 | 213 | 213 | 6199 | 6199 |

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