

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2020

Fecha de Información: 06 de febrero 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\$2738.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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 | 363.3 | 457.6 | 123.0 | 63.0 | 195.6 | 161.3 | 139.0 |
| 15-35 | 993.8 | 741.7 | 272.0 | 442.5 | 97.4 | 179.0 | 372.3 |
| 36-60 | 25.7 | 12.8 | 0.0 | 0.0 | 12.8 | 25.7 | 0.0 |
| 61-90 | 57.1 | 188.3 | 130.0 | 0.0 | 6.3 | 5.1 | 52.0 |
| 91-180 | 156.7 | 184.0 | 110.0 | 20.0 | 13.0 | 75.7 | 61.0 |
| >180 | 119.9 | 84.9 | 50.0 | 90.0 | 11.9 | 6.9 | 23.0 |
| Total | 1716.4 | 1669.3 | 685.0 | 615.5 | 337.0 | 453.6 | 647.3 |

* 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 | 1.7 % | 1.8 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 15-35 | 1.7 % | 1.8 % | 1.7 % | 1.7 % |
| 36-60 | - | 2.2 % | 1.9 % | 2.0 % |
| 61-90 | 2.0 % | 2.3 % | 2.1 % | 2.1 % |
| 91-180 | 2.2 % | 2.2 % | 2.1 % | 2.2 % |
| >180 | 2.4 % | 2.5 % | 2.5 % | 2.5 % |
| Total | 1.8 % | 1.9 % | 1.8 % | 1.8 % |

* 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 | 3 al 7 de febrero | | | | 10 al 14 de febrero | | | | 17 al 21 de febrero | | | |
|----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 20 | 131 | 4705 | 4601 | 39 | 185 | 4254 | 4699 | 56 | 134 | 4605 | 3895 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1926 | 1961 | 0 | 0 | 2229 | 1625 | 0 | 0 | 1561 | 1586 |
| Otros | 131 | 20 | 980 | 1050 | 185 | 39 | 1085 | 1244 | 134 | 56 | 762 | 1446 |
| Total | 152 | 152 | 7611 | 7611 | 224 | 224 | 7568 | 7568 | 191 | 191 | 6927 | 6927 |

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