

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2020

Fecha de Información: 12 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\$2884.5 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 | 750.8 | 382.0 | 130.5 | 532.5 | 59.5 | 26.3 | 192.0 |
| 15-35 | 794.6 | 987.2 | 591.5 | 322.3 | 86.7 | 163.4 | 309.0 |
| 36-60 | 65.9 | 56.4 | 10.0 | 0.0 | 46.4 | 65.9 | 0.0 |
| 61-90 | 81.7 | 62.5 | 0.0 | 40.0 | 37.5 | 16.7 | 25.0 |
| 91-180 | 60.6 | 82.0 | 0.0 | 0.0 | 22.0 | 0.6 | 60.0 |
| >180 | 70.6 | 136.2 | 70.0 | 10.0 | 6.2 | 0.6 | 60.0 |
| Total | 1824.1 | 1706.4 | 802.0 | 904.8 | 258.4 | 273.3 | 646.0 |

* 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 intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.8 % | 2.1 % | 1.6 % | 1.8 % |
| 15-35 | 1.9 % | 1.9 % | 1.5 % | 1.8 % |
| 36-60 | - | 2.2 % | 2.1 % | 2.1 % |
| 61-90 | 2.3 % | 2.4 % | 2.2 % | 2.3 % |
| 91-180 | 2.4 % | 2.7 % | 2.1 % | 2.5 % |
| >180 | 2.5 % | 2.6 % | 2.5 % | 2.5 % |
| Total | 2.0 % | 2.0 % | 1.6 % | 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 | 10 al 14 de febrero | | | | 17 al 21 de febrero | | | | 24 al 28 de febrero | | | |
|----------------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 34 | 150 | 5410 | 5570 | 59 | 137 | 5076 | 4419 | 23 | 137 | 5602 | 5429 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2746 | 2347 | 0 | 0 | 1694 | 1703 | 0 | 0 | 2043 | 2046 |
| Otros | 150 | 34 | 1099 | 1339 | 137 | 59 | 892 | 1540 | 137 | 23 | 1360 | 1529 |
| Total | 184 | 184 | 9255 | 9255 | 196 | 196 | 7662 | 7662 | 160 | 160 | 9004 | 9004 |

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