

Fecha de Publicación: 4 de enero de 2019

Fecha de Información: 02 de enero de 2019 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\$802.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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 | 210.1 | 62.0 | 46.3 | 195.6 | 15.7 | 14.6 | 0.0 |
| 15-35 | 141.7 | 345.2 | 285.0 | 78.5 | 9.2 | 12.2 | 51.0 |
| 36-60 | 0.7 | 6.4 | 0.0 | 0.0 | 6.4 | 0.7 | 0.0 |
| 61-90 | 55.1 | 65.1 | 0.0 | 0.5 | 15.1 | 4.6 | 50.0 |
| 91-180 | 0.2 | 7.3 | 0.0 | 0.0 | 7.3 | 0.2 | 0.0 |
| >180 | 0.9 | 8.9 | 0.0 | 0.0 | 8.9 | 0.9 | 0.0 |
| Total | 408.7 | 494.9 | 331.3 | 274.6 | 62.6 | 33.1 | 101.0 |

* 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 | - | 2.2 % | 1.2 % | 1.5 % |
| 15-35 | 1.8 % | 1.9 % | 1.8 % | 1.9 % |
| 36-60 | - | 2.3 % | 1.4 % | 2.2 % |
| 61-90 | 1.7 % | 1.8 % | 1.4 % | 1.7 % |
| 91-180 | - | 1.7 % | 1.3 % | 1.7 % |
| >180 | - | 1.8 % | 1.1 % | 1.8 % |
| Total | 1.7 % | 2.0 % | 1.4 % | 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 | 31 de dic. al 4 de enero | | | | 7 al 11 de enero | | | | 14 al 18 de enero | | | |
|----------------------------------|--------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 25 | 57 | 2077 | 2345 | 21 | 85 | 2785 | 3700 | 32 | 121 | 4338 | 4390 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1375 | 1094 | 0 | 0 | 2299 | 1118 | 0 | 0 | 2072 | 1124 |
| Otros | 57 | 25 | 170 | 182 | 85 | 21 | 321 | 588 | 121 | 32 | 1061 | 1957 |
| Total | 82 | 82 | 3622 | 3622 | 106 | 106 | 5405 | 5405 | 154 | 154 | 7472 | 7472 |

* 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 intragrupo.