

Fecha de Publicación: 11 de enero de 2019

Fecha de Información: 09 de enero de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1802.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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 | 487.6 | 206.5 | 77.0 | 378.7 | 57.5 | 36.9 | 72.0 |
| 15-35 | 433.8 | 625.8 | 472.4 | 244.8 | 29.9 | 65.6 | 123.5 |
| 36-60 | 29.5 | 41.9 | 1.5 | 23.0 | 40.4 | 6.5 | 0.0 |
| 61-90 | 75.4 | 26.0 | 0.0 | 0.0 | 26.0 | 75.4 | 0.0 |
| 91-180 | 0.7 | 19.9 | 0.0 | 0.0 | 19.9 | 0.7 | 0.0 |
| >180 | 30.1 | 20.8 | 15.0 | 30.0 | 5.8 | 0.1 | 0.0 |
| Total | 1057.1 | 940.8 | 565.9 | 676.5 | 179.4 | 185.1 | 195.5 |

* 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 | |
| 3-14 | 1.4 % | 1.9 % | 1.1 % | 1.3 % |
| 15-35 | 1.4 % | 1.7 % | 1.3 % | 1.5 % |
| 36-60 | - | 1.7 % | 1.4 % | 1.5 % |
| 61-90 | - | 1.9 % | 1.4 % | 1.5 % |
| 91-180 | - | 1.9 % | 1.1 % | 1.8 % |
| >180 | - | 1.6 % | 1.5 % | 1.5 % |
| Total | 1.4 % | 1.7 % | 1.2 % | 1.5 % |

*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 | 7 al 11 de enero | | | | 14 al 18 de enero | | | | 21 al 25 de enero | | | |
|---------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 101 | 3667 | 3976 | 36 | 132 | 4701 | 4763 | 22 | 93 | 1817 | 2271 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2467 | 1941 | 0 | 0 | 2324 | 1360 | 0 | 0 | 1034 | 418 |
| Otros | 101 | 22 | 395 | 612 | 132 | 36 | 1121 | 2023 | 93 | 22 | 676 | 839 |
| Total | 123 | 123 | 6529 | 6529 | 168 | 168 | 8146 | 8146 | 115 | 115 | 3527 | 3527 |

* 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 intragrupo.