

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2019

Fecha de Información: 04 de febrero 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\$1301.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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 | 267.8 | 214.6 | 133.0 | 165.2 | 25.6 | 46.6 | 56.0 |
| 15-35 | 494.8 | 340.0 | 192.8 | 357.0 | 23.8 | 14.3 | 123.5 |
| 36-60 | 11.1 | 26.0 | 0.0 | 0.0 | 23.9 | 9.0 | 2.1 |
| 61-90 | 0.7 | 18.8 | 0.1 | 0.0 | 18.8 | 0.7 | 0.0 |
| 91-180 | 17.4 | 54.2 | 0.1 | 5.0 | 47.9 | 6.2 | 6.2 |
| >180 | 31.3 | 22.7 | 0.0 | 20.0 | 12.7 | 1.3 | 10.0 |
| Total | 823.2 | 676.4 | 325.9 | 547.2 | 152.7 | 78.2 | 197.8 |

* 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 % | 1.4 % | 1.2 % | 1.3 % |
| 15-35 | 1.3 % | 1.5 % | 1.3 % | 1.3 % |
| 36-60 | 1.4 % | 1.8 % | 1.3 % | 1.7 % |
| 61-90 | - | 1.8 % | 1.4 % | 1.8 % |
| 91-180 | 1.6 % | 1.7 % | 2.4 % | 1.7 % |
| >180 | 1.7 % | 1.8 % | 1.6 % | 1.7 % |
| Total | 1.3 % | 1.5 % | 1.3 % | 1.4 % |

*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 | 4 al 8 de febrero | | | | 11 al 15 de febrero | | | | 18 al 22 de febrero | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 28 | 109 | 4386 | 4133 | 35 | 128 | 5153 | 4598 | 25 | 148 | 2517 | 3193 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2293 | 1975 | 0 | 0 | 1883 | 1645 | 0 | 0 | 1469 | 888 |
| Otros | 109 | 28 | 784 | 1355 | 128 | 35 | 1284 | 2066 | 148 | 25 | 872 | 777 |
| Total | 137 | 137 | 7462 | 7462 | 163 | 163 | 8319 | 8309 | 173 | 173 | 4858 | 4858 |

* 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.