

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2019

Fecha de Información: 04 de febrero de 2019 <sup>1</sup>

## 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%.<sup>2</sup>

**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           |
| <b>Total</b> | <b>823.2</b>        | <b>676.4</b> | <b>325.9</b>              | <b>547.2</b> | <b>152.7</b>  | <b>78.2</b> | <b>197.8</b>   |

\* 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         | 1.4 %              | 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 %        |
| <b>Total</b> | <b>1.3 %</b>       | <b>1.5 %</b>                 | <b>1.3 %</b> | <b>1.4 %</b> |

\*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           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 28                | 109        | 4386        | 4133        | 35                  | 128        | 5153        | 4598        | 25                  | 148        | 2517        | 3193        |
| <b>Intragrupo y off-shore***</b> | 0                 | 0          | 2293        | 1975        | 0                   | 0          | 1883        | 1645        | 0                   | 0          | 1469        | 888         |
| <b>Otros</b>                     | 109               | 28         | 784         | 1355        | 128                 | 35         | 1284        | 2066        | 148                 | 25         | 872         | 777         |
| <b>Total</b>                     | <b>137</b>        | <b>137</b> | <b>7462</b> | <b>7462</b> | <b>163</b>          | <b>163</b> | <b>8319</b> | <b>8309</b> | <b>173</b>          | <b>173</b> | <b>4858</b> | <b>4858</b> |

\* 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.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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.