

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2019

Fecha de Información: 18 de febrero 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\$494.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|-------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 152.6 | 101.1 | 0.0 | 47.0 | 16.1 | 20.6 | 85.0 |
| 15-35 | 52.5 | 199.5 | 47.0 | 8.0 | 108.5 | 0.5 | 44.0 |
| 36-60 | 2.2 | 1.6 | 0.0 | 0.0 | 1.6 | 2.2 | 0.0 |
| 61-90 | 101.5 | 1.7 | 0.0 | 0.0 | 1.7 | 101.5 | 0.0 |
| 91-180 | 0.5 | 8.7 | 0.0 | 0.0 | 8.7 | 0.5 | 0.0 |
| >180 | 1.6 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 1.6 | 0.0 |
| Total | 310.9 | 312.8 | 47.0 | 55.0 | 136.8 | 126.9 | 129.0 |

* 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 | 1.0 % | 1.7 % | 0.7 % | 0.9 % |
| 15-35 | 1.7 % | 0.6 % | 1.5 % | 0.9 % |
| 36-60 | - | 2.0 % | 1.5 % | 1.7 % |
| 61-90 | - | 2.0 % | 1.1 % | 1.1 % |
| 91-180 | - | 2.1 % | 1.1 % | 2.1 % |
| >180 | - | 4.3 % | 1.4 % | 1.5 % |
| Total | 1.2 % | 0.8 % | 1.0 % | 1.0 % |

*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 | 18 al 22 de febrero | | | | 25 de feb. al 1 de marzo | | | | 4 al 8 de marzo | | | |
|-----------------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 30 | 168 | 3214 | 4038 | 18 | 188 | 5630 | 5996 | 10 | 87 | 3452 | 3324 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2040 | 1289 | 0 | 0 | 2980 | 2378 | 0 | 0 | 1549 | 1257 |
| Otros | 168 | 30 | 986 | 913 | 188 | 18 | 862 | 1099 | 87 | 10 | 465 | 885 |
| Total | 199 | 199 | 6240 | 6240 | 206 | 206 | 9472 | 9472 | 96 | 96 | 5466 | 5466 |

* 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.