

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2019

Fecha de Información: 02 de mayo 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\$2697.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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 | 133.5 | 1030.6 | 351.5 | 56.0 | 611.6 | 10.0 | 67.5 |
| 15-35 | 318.9 | 348.8 | 175.0 | 41.8 | 98.3 | 201.6 | 75.5 |
| 36-60 | 13.3 | 34.3 | 0.0 | 0.0 | 30.3 | 9.3 | 4.0 |
| 61-90 | 907.8 | 5.1 | 0.0 | 300.0 | 0.1 | 602.8 | 5.0 |
| 91-180 | 21.1 | 10.4 | 3.0 | 0.0 | 7.0 | 20.7 | 0.4 |
| >180 | 24.8 | 11.1 | 0.0 | 1.4 | 1.1 | 13.4 | 10.0 |
| Total | 1419.4 | 1440.3 | 529.5 | 399.2 | 748.4 | 857.8 | 162.4 |

* 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 | 2.1 % | 1.8 % | 1.6 % | 1.8 % |
| 15-35 | 2.1 % | 2.1 % | 2.0 % | 2.0 % |
| 36-60 | 2.0 % | 2.2 % | 1.7 % | 2.1 % |
| 61-90 | 2.0 % | 2.2 % | 1.9 % | 1.9 % |
| 91-180 | 1.8 % | 0.2 % | 1.7 % | 1.3 % |
| >180 | 1.9 % | 2.1 % | 1.6 % | 1.7 % |
| Total | 2.1 % | 1.9 % | 1.9 % | 1.9 % |

*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 | 29 de abr. al 3 de mayo | | | | 6 al 10 de mayo | | | | 13 al 17 de mayo | | | |
|----------------------------------|-------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 18 | 102 | 4894 | 4628 | 27 | 107 | 4714 | 5609 | 35 | 135 | 2768 | 2746 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2130 | 1883 | 0 | 0 | 2663 | 1010 | 0 | 0 | 1075 | 523 |
| Otros | 102 | 18 | 1004 | 1517 | 107 | 27 | 1509 | 2268 | 135 | 35 | 773 | 1346 |
| Total | 120 | 120 | 8028 | 8028 | 134 | 134 | 8886 | 8886 | 169 | 169 | 4615 | 4615 |

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.