

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 11 de diciembre de 2018 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\$2269.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 553.6 | 386.5 | 173.1 | 365.5 | 82.5 | 57.2 | 130.9 |
| 15-35 | 381.9 | 536.7 | 355.8 | 133.0 | 22.9 | 90.9 | 158.0 |
| 36-60 | 183.6 | 47.9 | 0.0 | 14.2 | 32.9 | 154.4 | 15.0 |
| 61-90 | 217.2 | 178.8 | 81.8 | 130.0 | 89.9 | 80.2 | 7.0 |
| 91-180 | 4.4 | 17.5 | 10.7 | 0.0 | 6.7 | 4.4 | 0.0 |
| >180 | 43.0 | 69.0 | 13.0 | 0.0 | 16.0 | 3.0 | 40.0 |
| Total | 1383.7 | 1236.4 | 634.4 | 642.7 | 251.1 | 390.0 | 350.9 |

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

*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

| Sector | 10 al 14 de diciembre | | | | 17 al 21 de diciembre | | | | 24 al 28 de diciembre | | | |
|---------------------------|-----------------------|------------|--------------|--------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 46 | 152 | 7177 | 7027 | 56 | 208 | 4157 | 5233 | 15 | 163 | 2013 | 2399 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2528 | 2100 | 0 | 0 | 2924 | 1942 | 0 | 0 | 1229 | 954 |
| Otros | 152 | 46 | 2313 | 2891 | 208 | 56 | 768 | 674 | 163 | 15 | 386 | 275 |
| Total | 198 | 198 | 12018 | 12018 | 264 | 264 | 7850 | 7850 | 178 | 178 | 3628 | 3628 |

* 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.