

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 21 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\$892.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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 | 144.4 | 135.5 | 103.9 | 105.3 | 14.6 | 22.1 | 17.0 |
| 15-35 | 208.1 | 291.7 | 219.5 | 121.4 | 12.2 | 26.8 | 60.0 |
| 36-60 | 37.8 | 36.9 | 32.2 | 0.0 | 4.7 | 37.8 | 0.0 |
| 61-90 | 16.0 | 57.0 | 50.0 | 0.0 | 7.0 | 16.0 | 0.0 |
| 91-180 | 8.6 | 21.5 | 0.0 | 0.0 | 21.5 | 8.6 | 0.0 |
| >180 | 8.8 | 2.8 | 0.0 | 0.0 | 2.8 | 8.8 | 0.0 |
| Total | 423.7 | 545.3 | 405.6 | 226.6 | 62.7 | 120.1 | 77.0 |

* 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 | 1.8 % | 2.0 % | -2.1 % | 0.0 % |
| 15-35 | 1.9 % | 2.0 % | 1.7 % | 1.9 % |
| 36-60 | - | 2.2 % | 1.6 % | 1.6 % |
| 61-90 | - | 1.7 % | 1.4 % | 1.6 % |
| 91-180 | - | 1.9 % | 1.2 % | 1.7 % |
| >180 | - | 1.8 % | 1.1 % | 1.3 % |
| Total | 1.9 % | 1.9 % | 0.6 % | 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

| Sector | 17 al 21 de diciembre | | | | 24 al 28 de diciembre | | | | 31 de dic. al 4 de enero | | | |
|----------------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|--------------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 205 | 230 | 5385 | 6096 | 28 | 139 | 2438 | 2593 | 7 | 44 | 1826 | 2050 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 3335 | 2737 | 0 | 0 | 1264 | 1179 | 0 | 0 | 1133 | 897 |
| Otros | 230 | 205 | 896 | 782 | 139 | 28 | 450 | 380 | 44 | 7 | 152 | 164 |
| Total | 436 | 436 | 9615 | 9615 | 167 | 167 | 4152 | 4152 | 51 | 51 | 3111 | 3111 |

* 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.