

**Fecha de Publicación: 16 de enero de 2019**

**Fecha de Información: 14 de enero 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\$1609.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	346.5	175.8	81.9	197.5	36.4	91.5	57.5
15-35	599.2	643.0	208.5	204.9	149.0	108.8	285.5
36-60	11.6	26.7	0.0	0.0	26.7	11.6	0.0
61-90	0.3	17.4	0.0	0.0	17.4	0.3	0.0
91-180	10.8	30.6	0.0	0.0	30.6	10.8	0.0
>180	9.5	81.2	0.0	9.1	81.2	0.4	0.0
<b>Total</b>	<b>977.9</b>	<b>974.6</b>	<b>290.4</b>	<b>411.5</b>	<b>341.2</b>	<b>223.4</b>	<b>343.0</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	
3-14	1.5 %	2.1 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	2.3 %	1.4 %	2.0 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	14 al 18 de enero				21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	138	5436	5437	30	102	1924	2473	27	90	2655	2712
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2496	1719	0	0	1158	439	0	0	1037	844
Otros	138	39	1362	2138	102	30	691	861	90	27	1016	1152
Total	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>9294</b>	<b>9294</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>3773</b>	<b>3773</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4707</b>	<b>4707</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.