

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1646.8 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	235.8	183.6	106.8	152.5	44.8	51.3	32.0
15-35	528.4	354.5	189.5	294.7	48.5	117.2	116.5
36-60	137.7	235.8	70.0	0.0	165.8	137.7	0.0
61-90	2.0	11.1	0.8	0.0	10.3	2.0	0.0
91-180	0.8	53.0	0.0	0.0	53.0	0.8	0.0
>180	14.6	38.0	30.0	13.0	8.0	1.6	0.0
<b>Total</b>	<b>919.2</b>	<b>876.1</b>	<b>397.1</b>	<b>460.2</b>	<b>330.5</b>	<b>310.6</b>	<b>148.5</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	Compras	Ventas	
3-14	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	1.8 %	1.1 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.4 %	1.8 %
>180	-	1.7 %	0.7 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.4 %</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.

**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
Sector Financiero**	37	142	5613	5474	31	102	1975	2605	27	91	2694	2729
Intragrupo y off-shore***	0	0	2512	1866	0	0	1247	444	0	0	1038	873
Otros	142	37	1363	2148	102	31	729	901	91	27	1024	1154
<b>Total</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>9488</b>	<b>9488</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>3950</b>	<b>3950</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4756</b>	<b>4756</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.

<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.