

**Fecha de Publicación: 22 de enero de 2019**

**Fecha de Información: 18 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\$1494.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	331.5	109.8	23.0	225.6	26.8	45.9	60.0
15-35	386.2	608.4	350.9	196.0	143.5	76.2	114.0
36-60	77.2	77.2	30.0	0.0	17.2	47.2	30.0
61-90	26.4	22.3	0.0	10.0	12.3	6.4	10.0
91-180	1.2	39.7	0.0	0.0	39.7	1.2	0.0
>180	11.8	16.5	10.0	10.0	6.5	1.8	0.0
<b>Total</b>	<b>834.4</b>	<b>873.7</b>	<b>413.9</b>	<b>441.6</b>	<b>245.9</b>	<b>178.8</b>	<b>214.0</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	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	1.8 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.8 %	1.4 %	1.8 %
>180	-	2.2 %	1.4 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.4 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	38	142	6344	6059	31	117	2795	3049	27	97	2972	2886
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2580	2061	0	0	1357	873	0	0	1062	926
<b>Otros</b>	142	38	1800	2604	117	31	882	1112	97	27	1017	1240
<b>Total</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>10724</b>	<b>10724</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>5034</b>	<b>5034</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5051</b>	<b>5051</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.