

**Fecha de Publicación: 23 de enero de 2019**

**Fecha de Información: 21 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\$295.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruop y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65.1	171.2	115.0	5.0	2.2	6.1	54.0
15-35	47.4	56.6	55.0	46.0	1.6	1.4	0.0
36-60	0.0	1.2	0.0	0.0	1.2	0.0	0.0
61-90	0.0	0.4	0.0	0.0	0.4	0.0	0.0
91-180	0.4	6.3	0.0	0.0	6.3	0.4	0.0
>180	0.1	1.0	0.0	0.0	1.0	0.1	0.0
<b>Total</b>	<b>113.1</b>	<b>236.6</b>	<b>170.0</b>	<b>51.0</b>	<b>12.6</b>	<b>8.1</b>	<b>54.0</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 intragruop		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	1.6 %	-4.4 %	0.8 %
15-35	-	1.6 %	1.1 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	0.8 %	1.7 %
61-90	-	2.3 %	-	2.3 %
91-180	-	2.0 %	1.3 %	2.0 %
>180	-	1.6 %	0.2 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>-2.1 %</b>	<b>1.0 %</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	21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	114	3042	3292	27	97	2960	2979	13	78	3180	2999
Intragruop y off-shore***	0	0	1367	878	0	0	1167	926	0	0	1816	1460
Otros	114	30	1087	1326	97	27	979	1201	78	13	590	1128
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5496</b>	<b>5496</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5105</b>	<b>5105</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>5587</b>	<b>5587</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 intragruop.