

**Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2019**

**Fecha de Información: 30 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\$2076.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	407.0	314.7	118.5	208.8	46.2	48.2	150.0
15-35	680.6	855.7	385.2	204.1	146.9	152.9	323.6
36-60	11.3	27.7	20.0	0.0	7.7	11.3	0.0
61-90	45.6	66.8	27.5	0.0	25.8	32.1	13.5
91-180	9.3	28.9	0.0	0.0	28.9	9.3	0.0
>180	109.6	26.4	0.0	89.6	6.4	0.0	20.0
<b>Total</b>	<b>1263.4</b>	<b>1320.1</b>	<b>551.2</b>	<b>502.4</b>	<b>261.8</b>	<b>253.9</b>	<b>507.1</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	2.0 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</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	28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	95	4220	3826	25	97	3844	3725	29	110	4617	4140
Intragruo y off-shore***	0	0	1532	1684	0	0	2077	1637	0	0	1802	1439
Otros	95	35	1230	1471	97	25	692	1251	110	29	1045	1880
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>6981</b>	<b>6981</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>6613</b>	<b>6613</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>7464</b>	<b>7459</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 intragruo.