

**Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2019**

**Fecha de Información: 07 de febrero 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\$1954.5 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	347.4	476.0	320.0	171.0	19.5	39.9	136.5
15-35	478.2	604.8	411.5	200.0	44.8	129.7	148.5
36-60	29.3	21.4	0.0	22.6	21.4	6.7	0.0
61-90	22.4	52.6	0.0	0.0	32.6	2.4	20.0
91-180	122.5	44.5	0.0	100.0	24.5	2.5	20.0
>180	25.6	59.8	48.4	19.0	6.4	1.6	5.0
<b>Total</b>	<b>1025.4</b>	<b>1259.1</b>	<b>779.9</b>	<b>512.6</b>	<b>149.2</b>	<b>182.8</b>	<b>330.0</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	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.6 %	1.4 %	2.3 %
61-90	1.4 %	1.8 %	1.2 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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.

<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	4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	29	100	5033	4728	36	134	5709	5533	27	152	2718	3476
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2545	2271	0	0	2447	1858	0	0	1705	988
Otros	100	29	973	1552	134	36	1368	2123	152	27	836	795
Total	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>8551</b>	<b>8551</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>9524</b>	<b>9514</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>5259</b>	<b>5259</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.