

**Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2019**

**Fecha de Información: 08 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\$1472.0 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	192.4	518.8	417.0	95.0	12.8	8.4	89.0
15-35	555.8	338.3	132.2	299.5	64.1	114.3	142.0
36-60	1.1	6.8	0.0	0.0	6.8	1.1	0.0
61-90	41.3	10.7	0.0	30.0	5.7	6.3	5.0
91-180	5.8	22.1	0.3	0.0	21.8	5.8	0.0
>180	10.6	14.1	0.0	0.0	4.1	0.6	10.0
<b>Total</b>	<b>807.1</b>	<b>910.9</b>	<b>549.5</b>	<b>424.5</b>	<b>115.4</b>	<b>136.6</b>	<b>246.0</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	1.4 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	2.6 %	0.6 %	2.3 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-	2.2 %	1.4 %	2.0 %
>180	1.6 %	1.9 %	1.1 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</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	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	101	5033	4728	36	140	5897	5915	28	151	2721	3607
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2545	2271	0	0	2736	1953	0	0	1833	988
<b>Otros</b>	101	29	973	1552	140	36	1372	2127	151	28	839	798
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>8551</b>	<b>8551</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>10005</b>	<b>9995</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>5393</b>	<b>5393</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.