

**Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2019**

**Fecha de Información: 11 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\$1459.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	294.1	156.3	54.7	209.0	31.6	15.1	70.0
15-35	455.5	613.7	338.0	119.0	17.5	78.3	258.2
36-60	55.9	108.6	0.0	20.0	77.6	4.9	31.0
61-90	12.3	1.2	0.0	10.0	1.2	2.3	0.0
91-180	56.9	55.4	0.0	15.0	15.4	1.9	40.0
>180	47.6	46.2	0.0	0.0	1.2	2.6	45.0
<b>Total</b>	<b>922.2</b>	<b>981.5</b>	<b>392.7</b>	<b>373.0</b>	<b>144.6</b>	<b>105.0</b>	<b>444.2</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.2 %	1.0 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.9 %	1.6 %
36-60	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.6 %	2.6 %	1.3 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.5 %</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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	38	160	6159	5999	28	162	2746	3650	17	180	5231	5502
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2782	2157	0	0	1842	988	0	0	2762	2296
<b>Otros</b>	160	38	1360	2135	162	28	853	803	180	17	765	960
<b>Total</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>10301</b>	<b>10291</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>5441</b>	<b>5441</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>8758</b>	<b>8758</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 intragruppo.