

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2019

Fecha de Información: 14 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\$2300.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	238.7	172.1	106.0	160.4	61.1	73.4	5.0
15-35	748.8	1182.5	708.9	244.5	106.4	137.0	367.3
36-60	15.5	45.5	0.0	0.0	45.5	15.5	0.0
61-90	44.3	16.1	5.0	17.0	1.1	17.3	10.0
91-180	36.7	27.9	10.0	10.0	12.9	21.7	5.0
>180	85.5	118.9	70.0	35.0	3.9	5.5	45.0
<b>Total</b>	<b>1169.5</b>	<b>1563.1</b>	<b>899.9</b>	<b>466.9</b>	<b>230.9</b>	<b>270.3</b>	<b>432.3</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 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.5 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</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>	39	166	6578	6245	30	162	2910	3898	18	188	5508	5904
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2899	2436	0	0	1968	1058	0	0	2978	2339
<b>Otros</b>	166	39	1381	2167	162	30	973	896	188	18	830	1074
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>10858</b>	<b>10848</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5852</b>	<b>5852</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>9316</b>	<b>9316</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 intragruppo.