

**Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2019**

**Fecha de Información: 18 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\$494.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.<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	152.6	101.1	0.0	47.0	16.1	20.6	85.0
15-35	52.5	199.5	47.0	8.0	108.5	0.5	44.0
36-60	2.2	1.6	0.0	0.0	1.6	2.2	0.0
61-90	101.5	1.7	0.0	0.0	1.7	101.5	0.0
91-180	0.5	8.7	0.0	0.0	8.7	0.5	0.0
>180	1.6	0.1	0.0	0.0	0.1	1.6	0.0
<b>Total</b>	<b>310.9</b>	<b>312.8</b>	<b>47.0</b>	<b>55.0</b>	<b>136.8</b>	<b>126.9</b>	<b>129.0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	1.7 %	0.7 %	0.9 %
15-35	1.7 %	0.6 %	1.5 %	0.9 %
36-60	-	2.0 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.1 %	1.1 %
91-180	-	2.1 %	1.1 %	2.1 %
>180	-	4.3 %	1.4 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</b>	<b>0.8 %</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.0 %</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	18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	168	3214	4038	18	188	5630	5996	10	87	3452	3324
Intragruo y off-shore***	0	0	2040	1289	0	0	2980	2378	0	0	1549	1257
Otros	168	30	986	913	188	18	862	1099	87	10	465	885
<b>Total</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>6240</b>	<b>6240</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>9472</b>	<b>9472</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>5466</b>	<b>5466</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.