

**Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2019**

**Fecha de Información: 01 de marzo 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\$1563.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	314.3	356.1	171.7	138.7	23.4	14.7	161.0
15-35	482.9	682.3	363.9	162.6	29.9	31.8	288.5
36-60	3.2	46.2	0.0	0.0	46.2	3.2	0.0
61-90	55.5	47.6	20.0	30.0	16.6	14.5	11.0
91-180	1.3	17.2	0.0	0.0	17.2	1.3	0.0
>180	5.6	16.3	0.0	0.0	11.3	0.6	5.0
<b>Total</b>	<b>862.9</b>	<b>1165.8</b>	<b>555.5</b>	<b>331.2</b>	<b>144.8</b>	<b>66.1</b>	<b>465.5</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	1.7 %	1.7 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.8 %
61-90	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	1.9 %	1.0 %	1.9 %
>180	1.7 %	2.1 %	0.6 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</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	25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	189	7262	7259	18	104	4396	4646	19	137	3949	4573
Intragrupo y off-shore***	0	0	3759	3587	0	0	2150	1491	0	0	2087	841
Otros	189	21	1037	1213	104	18	718	1127	137	19	1032	1653
<b>Total</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>12058</b>	<b>12058</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>7265</b>	<b>7265</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>7068</b>	<b>7068</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 intragrupo.