

**Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2019**

**Fecha de Información: 05 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\$1288.1 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	137.0	91.8	77.5	116.5	14.3	20.5	0.0
15-35	388.4	396.8	196.5	87.5	3.8	104.4	196.5
36-60	50.3	36.1	0.0	0.0	1.1	15.3	35.0
61-90	125.1	8.8	0.0	0.0	8.8	125.1	0.0
91-180	12.7	3.1	0.0	0.0	3.1	12.7	0.0
>180	209.7	214.8	10.0	30.0	49.8	24.7	155.0
<b>Total</b>	<b>923.2</b>	<b>751.4</b>	<b>284.0</b>	<b>234.0</b>	<b>80.9</b>	<b>302.7</b>	<b>386.5</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	Compras	Ventas	
3-14	-	1.4 %	1.4 %	1.4 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.7 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	1.8 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</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.

<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 intragrupo.

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

Sectores	4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	110	4750	4833	19	138	4201	4855	28	139	3020	3995
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2258	1754	0	0	2135	848	0	0	2375	1304
<b>Otros</b>	110	18	716	1139	138	19	1065	1698	139	28	504	599
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>7725</b>	<b>7725</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>7401</b>	<b>7401</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>5898</b>	<b>5898</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.