

**Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2019**

**Fecha de Información: 12 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\$2235.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	570.4	311.5	160.8	442.5	79.6	56.8	71.1
15-35	539.9	1057.9	704.5	87.3	37.4	136.7	316.0
36-60	19.0	5.2	0.0	0.0	5.2	19.0	0.0
61-90	1.7	9.8	0.0	0.0	9.8	1.7	0.0
91-180	35.8	26.4	10.0	10.0	6.4	15.8	10.0
>180	48.3	6.6	0.0	40.0	6.6	8.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1215.1</b>	<b>1417.4</b>	<b>875.3</b>	<b>579.8</b>	<b>145.0</b>	<b>238.2</b>	<b>397.1</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	2.0 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.7 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	3.1 %	1.5 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.1 %	1.9 %
91-180	1.7 %	2.3 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	2.0 %	1.8 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</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.

<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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Nota: Debido a inconsistencias en la información del 12 de marzo de 2019 se retransmiten los informes de los días 12, 13, 14 y 15 de marzo de 2019.

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

Sectores	11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	144	5333	5576	28	139	3655	4932	19	185	2001	2468
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2436	1650	0	0	2867	1497	0	0	1215	772
<b>Otros</b>	144	20	1241	1784	139	28	655	748	185	19	655	631
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>9010</b>	<b>9010</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>7177</b>	<b>7177</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>3871</b>	<b>3871</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.