

**Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2019**

**Fecha de Información: 14 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\$2999.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

<b>Rango</b>	<b>Sector Financiero**</b>		<b>Intragrupo y Off-shore***</b>		<b>Otros Agentes</b>		<b>Interbancarios</b>
	<b>Compras</b>	<b>Ventas</b>	<b>Compras</b>	<b>Ventas</b>	<b>Compras</b>	<b>Ventas</b>	
3-14	844.6	545.4	199.0	500.0	47.4	45.6	299.0
15-35	557.4	955.7	744.5	327.5	21.2	39.9	190.0
36-60	33.4	173.4	161.0	23.8	3.4	0.6	9.0
61-90	30.6	57.6	30.0	20.0	17.6	0.6	10.0
91-180	131.3	104.8	25.0	50.0	24.8	26.3	55.0
>180	124.9	83.8	0.0	30.0	3.8	14.9	80.0
<b>Total</b>	<b>1722.1</b>	<b>1920.6</b>	<b>1159.5</b>	<b>951.3</b>	<b>118.1</b>	<b>127.8</b>	<b>643.0</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**

<b>Rango</b>	<b>Sector Financiero*</b>	<b>Otros Agentes sin intragrupo</b>		<b>Total</b>
		<b>Compras</b>	<b>Ventas</b>	
3-14	2.2 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	1.6 %	2.2 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
91-180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.7 %	2.3 %	1.8 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>2.0 %</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado)  $^{(360/\text{Plazo})}$  - 1). Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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	145	5679	5678	29	145	4546	5580	24	189	2216	2588
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2446	1913	0	0	3084	1975	0	0	1226	864
<b>Otros</b>	145	20	1254	1788	145	29	739	815	189	24	698	688
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>9379</b>	<b>9379</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>8369</b>	<b>8369</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>4141</b>	<b>4141</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.