

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1380.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	121.4	204.6	148.0	70.7	36.6	30.7	20.0
15-35	342.4	507.6	364.0	131.8	50.6	117.6	93.0
36-60	51.4	8.3	0.0	0.0	8.3	51.4	0.0
61-90	2.1	116.7	80.0	0.0	36.7	2.1	0.0
91-180	81.1	12.1	0.0	70.0	12.1	11.1	0.0
>180	37.7	33.4	4.3	10.0	4.1	2.7	25.0
<b>Total</b>	<b>636.0</b>	<b>882.7</b>	<b>596.3</b>	<b>282.4</b>	<b>148.4</b>	<b>215.6</b>	<b>138.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	2.2 %	1.4 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.9 %
91-180	-	2.2 %	1.4 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.2 %	1.5 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</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**

Sector	18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	186	5306	5870	25	140	2408	2987	5	112	3115	3645
Intragrupo y off-shore***	0	0	3200	2559	0	0	1520	964	0	0	1889	995
Otros	186	30	791	868	140	25	783	760	112	5	298	662
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>9297</b>	<b>9297</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>4710</b>	<b>4710</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>5302</b>	<b>5302</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.