

**Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2019**

**Fecha de Información: 26 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\$1758.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

| Rango        | Sector Financiero** |               | Intragruo y Off-shore*** |              | Otros Agentes |              | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|--------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas        | Compras                  | Ventas       | Compras       | Ventas       |                |
| 3-14         | 467.0               | 354.1         | 221.8                    | 343.0        | 60.7          | 52.5         | 71.6           |
| 15-35        | 278.1               | 586.0         | 468.7                    | 137.0        | 25.3          | 49.1         | 92.0           |
| 36-60        | 11.6                | 9.5           | 0.0                      | 0.0          | 9.5           | 11.6         | 0.0            |
| 61-90        | 23.5                | 16.5          | 11.2                     | 14.3         | 5.3           | 9.2          | 0.0            |
| 91-180       | 49.7                | 57.8          | 0.0                      | 40.0         | 52.8          | 4.7          | 5.0            |
| >180         | 70.4                | 62.4          | 0.0                      | 5.3          | 2.4           | 5.1          | 60.0           |
| <b>Total</b> | <b>900.4</b>        | <b>1086.4</b> | <b>701.7</b>             | <b>539.6</b> | <b>156.1</b>  | <b>132.2</b> | <b>228.6</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 intragruo |              | Total        |
|--------------|--------------------|-----------------------------|--------------|--------------|
|              |                    | Compras                     | Ventas       |              |
| 3-14         | 2.4 %              | 2.2 %                       | 1.5 %        | 1.9 %        |
| 15-35        | 2.2 %              | 2.2 %                       | 2.2 %        | 2.2 %        |
| 36-60        | -                  | 2.2 %                       | 1.7 %        | 1.9 %        |
| 61-90        | -                  | 1.9 %                       | 1.5 %        | 1.6 %        |
| 91-180       | 1.9 %              | 2.0 %                       | 1.8 %        | 1.9 %        |
| >180         | 1.9 %              | 2.0 %                       | 1.5 %        | 1.8 %        |
| <b>Total</b> | <b>2.2 %</b>       | <b>2.2 %</b>                | <b>1.8 %</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.

**Cuadro No. 3  
Vencimientos de Forwards**

| Sectores                 | 25 al 29 de marzo |            |             |             | 1 al 5 de abril |            |             |             | 8 al 12 de abril |            |             |             |
|--------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
|                          | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery        |            | NDF         |             | Delivery         |            | NDF         |             |
|                          | C                 | V          | C           | V           | C               | V          | C           | V           | C                | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**      | 24                | 140        | 2785        | 3168        | 5               | 112        | 3163        | 3783        | 48               | 114        | 4466        | 4356        |
| Intragruo y off-shore*** | 0                 | 0          | 1663        | 1294        | 0               | 0          | 1967        | 1008        | 0                | 0          | 2551        | 1183        |
| Otros                    | 140               | 24         | 794         | 780         | 112             | 5          | 333         | 672         | 114              | 48         | 683         | 2160        |
| <b>Total</b>             | <b>164</b>        | <b>164</b> | <b>5242</b> | <b>5242</b> | <b>117</b>      | <b>117</b> | <b>5464</b> | <b>5464</b> | <b>162</b>       | <b>162</b> | <b>7700</b> | <b>7700</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 intragruo.