

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**		Intragrupa 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	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

Sector	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
<b>Sector Financiero**</b>	24	140	2785	3168	5	112	3163	3783	48	114	4466	4356
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1663	1294	0	0	1967	1008	0	0	2551	1183
<b>Otros</b>	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 intragrupo.