

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2019

Fecha de Información: 16 de abril 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\$1397.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	310.0	149.0	60.6	259.5	60.4	22.5	28.0
15-35	238.4	559.2	411.0	81.3	43.2	52.1	105.0
36-60	7.7	74.4	53.0	0.2	21.4	7.5	0.0
61-90	8.3	5.9	0.1	0.0	5.8	8.3	0.0
91-180	11.1	20.9	4.8	0.0	16.1	11.1	0.0
>180	137.2	38.7	0.0	104.6	8.7	2.6	30.0
<b>Total</b>	<b>712.6</b>	<b>848.1</b>	<b>529.5</b>	<b>445.6</b>	<b>155.6</b>	<b>104.1</b>	<b>163.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
15-35	2.0 %	2.4 %	1.9 %	2.3 %
36-60	-	2.7 %	5.7 %	3.0 %
61-90	-	2.1 %	4.1 %	3.2 %
91-180	-	2.0 %	2.7 %	2.3 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</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	15 al 19 de abril				22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	53	102	3860	3988	15	165	4380	4634	12	145	3472	3452
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2525	2384	0	0	2501	1562	0	0	1749	1348
<b>Otros</b>	102	53	252	265	165	15	823	1508	145	12	602	1023
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>6636</b>	<b>6636</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>7704</b>	<b>7704</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>5823</b>	<b>5823</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.