

Fecha de Publicación: 23 de abril de 2019

Fecha de Información: 17 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\$765.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	230.0	217.2	50.5	37.4	12.2	38.1	154.5
15-35	162.0	277.9	193.5	56.5	3.9	25.0	80.5
36-60	2.4	8.3	0.0	0.0	8.3	2.4	0.0
61-90	38.0	53.2	21.8	0.0	1.5	8.0	30.0
91-180	1.3	17.1	0.1	0.0	17.0	1.3	0.0
>180	6.6	16.1	0.0	0.0	16.1	6.6	0.0
<b>Total</b>	<b>440.3</b>	<b>590.0</b>	<b>265.9</b>	<b>93.9</b>	<b>59.0</b>	<b>81.4</b>	<b>265.0</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	2.0 %	2.1 %	1.3 %	1.9 %
15-35	2.0 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
61-90	2.0 %	2.3 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	2.5 %	1.0 %	2.4 %
>180	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.6 %</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**

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	101	3860	3989	15	164	4561	4808	12	148	3537	3523
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2525	2384	0	0	2551	1599	0	0	1771	1348
<b>Otros</b>	101	53	252	265	164	15	833	1538	148	12	601	1038
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>6637</b>	<b>6637</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>7945</b>	<b>7945</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5909</b>	<b>5909</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 intragruppo.