

**Fecha de Publicación: 30 de abril de 2019**

**Fecha de Información: 26 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\$1602.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	170.5	141.9	60.0	82.5	23.5	29.6	58.4
15-35	596.6	623.0	274.4	71.5	289.2	465.7	59.4
36-60	28.5	8.8	0.0	0.0	3.8	23.5	5.0
61-90	31.8	3.3	0.0	10.0	3.3	21.8	0.0
91-180	21.1	8.7	0.0	3.3	8.7	17.8	0.0
>180	78.0	17.9	0.0	7.0	12.9	66.0	5.0
<b>Total</b>	<b>926.5</b>	<b>803.6</b>	<b>334.4</b>	<b>174.3</b>	<b>341.4</b>	<b>624.4</b>	<b>127.8</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 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.0 %	2.5 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	1.8 %
91-180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</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.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	223	5578	5167	18	98	4405	4272	23	99	4453	4500
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2699	2406	0	0	1947	1528	0	0	2310	907
<b>Otros</b>	223	15	871	1574	98	18	969	1521	99	23	882	2237
<b>Total</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>9148</b>	<b>9148</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>7321</b>	<b>7321</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>7645</b>	<b>7645</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.