

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2019

Fecha de Información: 06 de mayo 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\$2033.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	352.4	327.2	177.5	211.0	47.7	39.4	102.0
15-35	700.3	608.6	338.5	241.0	155.6	344.8	114.5
36-60	33.4	39.6	0.0	0.0	39.6	33.4	0.0
61-90	14.6	31.6	0.0	0.0	31.6	14.6	0.0
91-180	21.5	25.1	0.0	3.7	25.1	17.9	0.0
>180	74.1	24.2	20.0	66.1	1.2	5.0	3.0
<b>Total</b>	<b>1196.4</b>	<b>1056.2</b>	<b>536.0</b>	<b>521.8</b>	<b>300.7</b>	<b>455.1</b>	<b>219.5</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	2.0 %	1.8 %	2.0 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.0 %	1.2 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</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	6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	30	109	5427	5988	35	134	2933	2997	21	204	2982	4565
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2821	1567	0	0	1219	589	0	0	2859	849
<b>Otros</b>	109	30	1588	2281	134	35	815	1381	204	21	788	1214
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>9836</b>	<b>9836</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>4967</b>	<b>4967</b>	<b>225</b>	<b>225</b>	<b>6628</b>	<b>6628</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.