

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2019

Fecha de Información: 12 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\$800.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	149.5	96.3	29.3	78.7	6.7	10.6	60.3
15-35	317.7	256.8	125.5	102.5	58.8	142.7	72.5
36-60	10.5	7.8	0.0	0.0	7.8	10.5	0.0
61-90	7.9	15.4	0.0	2.5	15.4	5.4	0.0
91-180	1.9	29.1	10.5	0.0	18.6	1.9	0.0
>180	36.7	18.2	0.0	10.8	3.2	10.9	15.0
<b>Total</b>	<b>524.3</b>	<b>423.6</b>	<b>165.3</b>	<b>194.5</b>	<b>110.5</b>	<b>182.0</b>	<b>147.8</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	2.8 %	1.0 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	2.5 %	1.7 %	2.1 %
61-90	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %
91-180	-	2.0 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</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	8 al 12 de abril				15 al 19 de abril				22 al 26 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	71	136	7037	6562	53	101	3359	3834	10	164	4166	4484
Intragrupa y off-shore***	0	0	3032	2768	0	0	2486	1992	0	0	2431	1411
Otros	136	71	1623	2362	101	53	235	255	164	10	791	1493
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>11692</b>	<b>11692</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>6081</b>	<b>6081</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>7387</b>	<b>7387</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.