

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1142.1 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	437.6	219.2	74.3	293.5	26.3	25.6	118.5
15-35	160.3	437.0	321.3	28.0	17.7	34.3	98.0
36-60	9.5	18.2	0.0	0.0	18.2	9.5	0.0
61-90	10.0	0.7	0.0	0.0	0.7	10.0	0.0
91-180	36.4	14.8	8.0	31.7	6.8	4.7	0.0
>180	11.5	13.3	0.0	0.0	3.3	1.5	10.0
<b>Total</b>	<b>665.3</b>	<b>703.2</b>	<b>403.6</b>	<b>353.2</b>	<b>73.1</b>	<b>85.7</b>	<b>226.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	1.6 %	2.0 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	1.8 %
91-180	-	2.3 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.2 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.7 %</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**

Sector	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	100	3722	3978	12	164	4226	4557	11	151	3452	3295
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2516	2249	0	0	2475	1448	0	0	1630	1338
<b>Otros</b>	100	53	251	262	164	12	800	1497	151	11	564	1013
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>6489</b>	<b>6489</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>7501</b>	<b>7501</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5646</b>	<b>5646</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.