

Fecha de Publicación: 9 de mayo de 2019

Fecha de Información: 07 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\$2751.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	466.4	336.1	134.0	237.9	33.3	59.7	168.8
15-35	685.4	662.7	476.7	233.0	34.9	301.3	151.1
36-60	48.1	140.1	123.6	6.0	0.5	26.1	16.0
61-90	269.7	300.0	10.0	0.0	290.0	269.7	0.0
91-180	35.7	8.4	0.0	0.0	7.4	34.7	1.0
>180	106.5	62.2	3.2	21.3	26.0	52.2	33.0
<b>Total</b>	<b>1611.8</b>	<b>1509.4</b>	<b>747.5</b>	<b>498.1</b>	<b>392.0</b>	<b>743.8</b>	<b>369.9</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	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	1.9 %	2.0 %	2.1 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.9 %	1.9 %
91-180	1.8 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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 intragrupo.

**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>	28	113	5778	6179	35	134	2977	3042	24	205	3152	4701
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2879	1799	0	0	1230	595	0	0	2961	849
<b>Otros</b>	113	28	1602	2282	134	35	819	1389	205	24	802	1364
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>10260</b>	<b>10260</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5026</b>	<b>5026</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>6915</b>	<b>6915</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.