

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2019

Fecha de Información: 15 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\$2102.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	229.9	183.3	110.5	162.0	22.8	17.9	50.0
15-35	505.7	765.1	455.9	88.5	28.2	136.2	281.0
36-60	299.9	7.5	0.0	100.0	7.5	199.9	0.0
61-90	76.7	53.4	0.0	20.0	53.4	56.7	0.0
91-180	40.9	12.2	0.0	30.0	12.2	10.9	0.0
>180	243.6	145.5	11.6	100.0	3.9	13.6	130.0
<b>Total</b>	<b>1396.7</b>	<b>1166.9</b>	<b>578.0</b>	<b>500.5</b>	<b>128.0</b>	<b>435.2</b>	<b>461.0</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 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
15-35	2.1 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
36-60	-	5.3 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.9 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>1.9 %</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.

**Cuadro No. 3**  
Vencimientos de Forwards

Sectores	13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	142	4320	4004	41	209	4032	5348	8	158	2964	3147
Intragrupa y off-shore***	0	0	1666	1390	0	0	3212	1235	0	0	1517	985
Otros	142	30	831	1423	209	41	898	1560	158	8	932	1282
<b>Total</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>6817</b>	<b>6817</b>	<b>250</b>	<b>250</b>	<b>8142</b>	<b>8142</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>5413</b>	<b>5413</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 intragrupo.