

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2019

Fecha de Información: 21 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\$2048.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	249.8	214.8	96.0	125.0	30.8	36.8	88.0
15-35	714.3	682.6	375.8	182.0	85.8	311.3	221.0
36-60	172.8	197.0	0.0	8.0	197.0	164.8	0.0
61-90	2.4	14.9	0.0	0.0	14.9	2.4	0.0
91-180	42.9	5.3	0.0	0.0	5.3	42.9	0.0
>180	13.6	56.9	45.3	0.0	1.6	3.6	10.0
<b>Total</b>	<b>1195.8</b>	<b>1171.5</b>	<b>517.1</b>	<b>315.0</b>	<b>335.4</b>	<b>561.8</b>	<b>319.0</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	2.2 %	2.5 %	1.2 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.0 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	2.0 %
91-180	-	2.2 %	1.8 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.2 %	1.4 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.8 %</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	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	147	5274	5862	15	178	3104	3448	21	84	3319	3999
Intragrupa y off-shore***	0	0	3437	2216	0	0	1732	1003	0	0	2214	1016
Otros	147	43	986	1620	178	15	981	1366	84	21	686	1203
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>9697</b>	<b>9697</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>5817</b>	<b>5817</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>6218</b>	<b>6218</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.