

**Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2019**

**Fecha de Información: 29 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\$2010.5 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	375.9	288.8	136.5	238.2	29.3	14.7	123.0
15-35	527.6	693.1	384.6	198.0	248.5	269.6	60.0
36-60	66.8	48.6	20.5	6.5	14.1	46.2	14.1
61-90	0.9	12.8	0.0	0.0	12.8	0.9	0.0
91-180	32.5	31.0	0.3	0.0	10.4	12.2	20.3
>180	135.7	104.1	0.0	20.0	14.1	25.7	90.0
<b>Total</b>	<b>1139.4</b>	<b>1178.4</b>	<b>541.9</b>	<b>462.7</b>	<b>329.2</b>	<b>369.3</b>	<b>307.4</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 %	2.3 %	1.4 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.3 %	1.9 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</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**

Sectores	29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	103	4673	4492	25	102	4554	4560	31	132	2681	2659
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2079	1726	0	0	2315	948	0	0	1041	503
<b>Otros</b>	103	18	987	1522	102	25	884	2244	132	31	759	1319
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>7739</b>	<b>7739</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>7752</b>	<b>7752</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>4481</b>	<b>4481</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.