

**Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2019**

**Fecha de Información: 30 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\$1817.4 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	319.5	222.0	62.5	173.5	47.0	33.5	112.5
15-35	512.4	543.1	389.3	160.7	44.3	242.2	109.5
36-60	58.2	125.9	84.0	0.0	8.9	25.2	33.0
61-90	0.8	15.6	1.1	0.0	14.6	0.8	0.0
91-180	130.9	48.0	0.0	115.0	38.0	5.9	10.0
>180	60.9	70.2	23.0	10.0	22.2	25.9	25.0
<b>Total</b>	<b>1082.6</b>	<b>1024.8</b>	<b>559.9</b>	<b>459.2</b>	<b>174.9</b>	<b>333.4</b>	<b>290.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %	3.9 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-	2.1 %	8.2 %	2.4 %
91-180	1.9 %	2.1 %	2.3 %	2.1 %
>180	1.9 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</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	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	100	4856	4608	26	106	4673	4645	32	134	2717	2696
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2130	1850	0	0	2325	994	0	0	1062	516
<b>Otros</b>	100	18	999	1527	106	26	898	2257	134	32	773	1340
<b>Total</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>7986</b>	<b>7986</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>7896</b>	<b>7896</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4552</b>	<b>4552</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.