

**Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2019**

**Fecha de Información: 02 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\$2697.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	133.5	1030.6	351.5	56.0	611.6	10.0	67.5
15-35	318.9	348.8	175.0	41.8	98.3	201.6	75.5
36-60	13.3	34.3	0.0	0.0	30.3	9.3	4.0
61-90	907.8	5.1	0.0	300.0	0.1	602.8	5.0
91-180	21.1	10.4	3.0	0.0	7.0	20.7	0.4
>180	24.8	11.1	0.0	1.4	1.1	13.4	10.0
<b>Total</b>	<b>1419.4</b>	<b>1440.3</b>	<b>529.5</b>	<b>399.2</b>	<b>748.4</b>	<b>857.8</b>	<b>162.4</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 intragrupo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %		1.8 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.1 %		2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.0 %		2.2 %	1.7 %	2.1 %
61-90	2.0 %		2.2 %	1.9 %	1.9 %
91-180	1.8 %		0.2 %	1.7 %	1.3 %
>180	1.9 %		2.1 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>		<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</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
Sector Financiero**	18	102	4894	4628	27	107	4714	5609	35	135	2768	2746
Intragrupo y off-shore***	0	0	2130	1883	0	0	2663	1010	0	0	1075	523
Otros	102	18	1004	1517	107	27	1509	2268	135	35	773	1346
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>8028</b>	<b>8028</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>8886</b>	<b>8886</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>4615</b>	<b>4615</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.