

**Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2019**

**Fecha de Información: 20 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\$2432.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	491.4	258.6	159.7	408.4	60.9	45.0	38.0
15-35	642.9	990.9	658.2	149.0	166.5	327.7	166.3
36-60	34.0	28.3	0.0	4.1	24.3	25.9	4.0
61-90	5.2	3.2	0.0	0.0	3.2	5.2	0.0
91-180	36.5	77.2	30.0	14.0	46.8	22.1	0.4
>180	34.4	38.0	30.0	20.1	7.9	14.2	0.1
<b>Total</b>	<b>1244.5</b>	<b>1396.2</b>	<b>877.9</b>	<b>595.6</b>	<b>309.6</b>	<b>440.1</b>	<b>208.8</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	
3-14	2.2 %	2.3 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.0 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.2 %	2.4 %	2.3 %
91-180	1.9 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	1.6 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.2 %</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	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**	45	142	5080	5735	13	176	3055	3369	15	84	3254	3926
Intragrupo y off-shore***	0	0	3376	2091	0	0	1697	1003	0	0	2194	1016
Otros	142	45	980	1611	176	13	964	1345	84	15	672	1178
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>9437</b>	<b>9437</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>5717</b>	<b>5717</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>6120</b>	<b>6120</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)  $^{\wedge}$  (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.