

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2019

Fecha de Información: 04 de junio 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\$2687.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<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	513.6	233.1	107.0	394.5	30.5	23.5	95.6
15-35	789.0	968.9	627.0	338.1	96.9	205.9	245.0
36-60	157.3	105.2	2.0	70.0	93.2	77.3	10.0
61-90	22.2	69.2	0.0	0.0	57.2	10.2	12.0
91-180	63.0	99.8	20.0	40.0	79.8	23.0	0.0
>180	25.0	9.0	0.0	16.0	4.0	4.0	5.0
<b>Total</b>	<b>1570.3</b>	<b>1485.2</b>	<b>756.0</b>	<b>858.6</b>	<b>361.6</b>	<b>344.1</b>	<b>367.6</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	2.4 %	2.9 %	1.8 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.2 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.4 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</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	3 al 7 de junio				10 al 14 de junio				17 al 21 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	79	4631	4589	66	97	4600	4807	22	170	4500	5895
Intragrupa y off-shore***	0	0	2453	1972	0	0	2502	1199	0	0	3363	1263
Otros	79	41	786	1309	97	66	793	1889	170	22	878	1583
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>7870</b>	<b>7870</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>7895</b>	<b>7895</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>8741</b>	<b>8741</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.