

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2019

Fecha de Información: 06 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\$3145.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	255.9	555.1	125.0	156.6	345.1	14.3	85.0
15-35	922.1	973.8	327.0	171.5	139.9	243.6	507.0
36-60	77.0	44.7	1.5	0.0	23.2	57.0	20.0
61-90	584.2	239.8	20.0	35.0	9.8	339.2	210.0
91-180	62.3	118.9	48.3	25.0	40.6	7.3	30.0
>180	62.5	101.2	74.0	20.0	27.3	42.5	0.0
<b>Total</b>	<b>1964.1</b>	<b>2033.5</b>	<b>595.7</b>	<b>408.1</b>	<b>585.8</b>	<b>704.0</b>	<b>852.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %	2.4 %	1.7 %	2.3 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	-	2.3 %	2.1 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</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**	42	79	4972	4680	68	100	4874	5468	22	185	4779	6083
Intragrupa y off-shore***	0	0	2486	2267	0	0	2648	1290	0	0	3439	1374
Otros	79	42	799	1310	100	68	1149	1913	185	22	880	1640
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>8257</b>	<b>8257</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>8671</b>	<b>8671</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>9098</b>	<b>9098</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.