

**Fecha de Publicación: 5 de junio de 2019**

**Fecha de Información: 31 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\$2567.7 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	685.6	299.1	80.0	440.5	27.1	53.1	192.0
15-35	663.9	832.4	594.5	240.3	23.9	209.6	214.0
36-60	64.4	69.1	0.0	0.0	64.1	59.4	5.0
61-90	37.8	38.4	10.0	0.0	28.3	37.8	0.0
91-180	39.7	47.9	12.2	0.0	25.7	29.7	10.0
>180	149.7	170.7	60.0	27.0	0.7	12.7	110.0
<b>Total</b>	<b>1641.2</b>	<b>1457.5</b>	<b>756.7</b>	<b>707.8</b>	<b>169.8</b>	<b>402.4</b>	<b>531.0</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 %	1.9 %
15-35	2.4 %		2.3 %	2.1 %	2.3 %
36-60	2.2 %		2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-		2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.1 %		2.1 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.0 %		2.4 %	1.8 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>		<b>2.3 %</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	27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio				10 al 14 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	185	4287	3989	42	83	4284	4497	62	93	4443	4741
Intragrupo y off-shore***	0	0	1905	1775	0	0	2406	1672	0	0	2484	1088
Otros	185	30	1036	1465	83	42	781	1302	93	62	779	1877
<b>Total</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>7228</b>	<b>7228</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>7471</b>	<b>7471</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>7706</b>	<b>7706</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.