

**Fecha de Publicación: 7 de junio de 2019**

**Fecha de Información: 05 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\$2778.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	599.2	375.1	128.5	340.3	36.6	48.9	210.0
15-35	760.7	894.9	470.5	160.0	51.5	227.9	372.8
36-60	238.6	218.6	0.0	0.0	218.6	238.6	0.0
61-90	46.8	104.4	0.0	0.0	66.4	8.8	38.0
91-180	40.0	29.2	0.0	10.0	29.2	30.0	0.0
>180	57.2	59.2	10.0	23.0	24.2	9.2	25.0
<b>Total</b>	<b>1742.5</b>	<b>1681.4</b>	<b>609.0</b>	<b>533.3</b>	<b>426.5</b>	<b>563.4</b>	<b>645.8</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	Compras	Ventas	
3-14	2.5 %		1.7 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %		2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-		2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	2.2 %		2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-		2.4 %	2.0 %	2.2 %
>180	2.0 %		2.4 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>		<b>2.3 %</b>	<b>2.2 %</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**

Sectores	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	4940	4668	68	99	4786	5012	22	180	4644	5998
Intragrupo y off-shore***	0	0	2481	2234	0	0	2555	1246	0	0	3411	1294
Otros	79	42	792	1311	99	68	816	1898	180	22	878	1641
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>8213</b>	<b>8213</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>8156</b>	<b>8156</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>8934</b>	<b>8934</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.