

**Fecha de Publicación: 12 de junio de 2019**

**Fecha de Información: 10 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\$1571.0 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	126.4	192.6	156.5	104.2	26.1	12.2	10.0
15-35	337.2	327.5	167.5	194.8	35.0	17.5	125.0
36-60	112.9	118.8	0.0	0.0	118.8	112.9	0.0
61-90	14.8	22.8	0.0	0.0	22.8	14.8	0.0
91-180	141.7	185.6	13.5	0.0	172.1	141.7	0.0
>180	57.0	113.5	50.0	10.0	18.5	2.0	45.0
<b>Total</b>	<b>790.2</b>	<b>960.9</b>	<b>387.5</b>	<b>309.0</b>	<b>393.4</b>	<b>301.2</b>	<b>180.0</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	
3-14	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.4 %
91-180	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.4 %</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	10 al 14 de junio				17 al 21 de junio				24 al 28 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	70	108	4854	5512	23	184	4468	5192	22	175	2753	3828
Intragrupo y off-shore***	0	0	2657	1312	0	0	2676	1145	0	0	1851	628
Otros	108	70	1173	1860	184	23	864	1671	175	22	907	1055
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>8684</b>	<b>8684</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>8008</b>	<b>8008</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>5510</b>	<b>5510</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.