

**Fecha de Publicación: 19 de junio de 2019**

**Fecha de Información: 17 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\$2440.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<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	487.7	195.1	104.0	393.1	12.1	15.7	79.0
15-35	305.7	965.9	464.5	60.9	409.4	152.7	92.0
36-60	105.4	78.6	10.0	0.0	68.6	105.4	0.0
61-90	5.9	0.6	0.0	0.0	0.6	5.9	0.0
91-180	413.1	37.7	25.1	0.0	12.5	413.1	0.0
>180	3.1	12.8	0.0	0.0	12.8	3.1	0.0
<b>Total</b>	<b>1320.8</b>	<b>1290.8</b>	<b>603.6</b>	<b>454.0</b>	<b>516.2</b>	<b>695.8</b>	<b>171.0</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	2.6 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	3.1 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.4 %	2.2 %	2.2 %
>180	-	2.4 %	1.8 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.5 %</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	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	185	5971	6195	29	176	3251	4549	11	64	2637	3641
Intragrupo y off-shore***	0	0	3160	2165	0	0	2227	790	0	0	2258	652
Otros	185	27	942	1712	176	29	950	1088	64	11	363	964
<b>Total</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>10072</b>	<b>10072</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>6427</b>	<b>6427</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>5257</b>	<b>5257</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.