

**Fecha de Publicación: 4 de julio de 2019**

**Fecha de Información: 02 de julio 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\$2403.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.<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	629.9	332.1	181.0	475.3	48.1	51.6	103.0
15-35	606.1	974.0	557.7	113.8	134.9	210.9	281.4
36-60	19.6	14.0	0.0	0.0	14.0	19.6	0.0
61-90	76.7	80.9	0.0	0.0	10.9	6.7	70.0
91-180	75.9	75.3	0.3	0.0	5.0	5.9	70.0
>180	23.0	20.1	0.0	10.8	20.1	12.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1431.2</b>	<b>1496.4</b>	<b>739.0</b>	<b>599.9</b>	<b>233.0</b>	<b>307.0</b>	<b>524.4</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	3.0 %	2.8 %	2.3 %	2.5 %
15-35	2.9 %	2.7 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	3.3 %	2.4 %	2.8 %
61-90	2.6 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.6 %	2.0 %	2.4 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.8 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.6 %</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	1 al 5 de julio				8 al 12 de julio				15 al 19 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	75	4309	4420	33	121	5709	6243	20	163	3724	4325
Intragrupo y off-shore***	0	0	2521	1810	0	0	2910	1730	0	0	1949	1098
Otros	75	31	518	1119	121	33	1601	2247	163	20	1296	1546
<b>Total</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>7349</b>	<b>7349</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>10220</b>	<b>10220</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>6969</b>	<b>6969</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.