

**Fecha de Publicación: 17 de julio de 2019**

**Fecha de Información: 15 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\$1407.7 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	279.8	99.4	14.8	175.8	16.6	36.0	68.0
15-35	315.2	429.9	150.7	47.0	61.8	50.7	217.5
36-60	328.2	141.5	0.0	0.0	141.5	328.2	0.0
61-90	6.3	5.8	1.0	0.0	4.8	6.3	0.0
91-180	2.4	20.0	11.3	0.0	8.7	2.4	0.0
>180	37.6	27.1	20.0	17.7	7.1	19.9	0.0
<b>Total</b>	<b>969.5</b>	<b>723.7</b>	<b>197.7</b>	<b>240.5</b>	<b>240.5</b>	<b>443.5</b>	<b>285.5</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	2.5 %	0.5 %	2.2 %	2.1 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
61-90	-	2.8 %	2.4 %	2.6 %
91-180	-	2.6 %	2.4 %	2.6 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.5 %</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.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	15 al 19 de julio				22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	114	4831	5198	60	135	3108	3410	13	94	2922	3977
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2259	1628	0	0	1898	1119	0	0	2185	868
Otros	114	26	1410	1676	135	60	529	1007	94	13	716	979
Total	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>8501</b>	<b>8501</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5535</b>	<b>5535</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>5824</b>	<b>5824</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.