

**Fecha de Publicación: 26 de julio de 2019**

**Fecha de Información: 24 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\$1945.7 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	333.4	235.4	135.2	229.5	20.2	23.9	80.0
15-35	479.4	778.0	446.7	62.7	49.3	134.7	282.0
36-60	268.0	126.6	0.0	0.0	126.6	268.0	0.0
61-90	17.3	4.3	0.0	0.0	4.3	17.3	0.0
91-180	14.8	15.9	0.0	0.0	10.9	9.8	5.0
>180	29.7	29.9	0.0	7.5	9.9	2.1	20.0
<b>Total</b>	<b>1142.6</b>	<b>1190.1</b>	<b>581.9</b>	<b>299.7</b>	<b>221.3</b>	<b>455.9</b>	<b>387.0</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	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %		2.5 %	1.7 %	2.0 %
15-35	2.4 %		2.4 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-		2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	-		2.6 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.3 %		2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.3 %		2.4 %	2.2 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>-</b>		<b>2.4 %</b>	<b>2.1 %</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	22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	60	157	4607	4473	16	108	4152	5211	6	129	3829	4194
Intragrupo y off-shore***	0	0	2401	2032	0	0	2555	1240	0	0	2189	1355
Otros	157	60	610	1113	108	16	989	1245	129	6	485	955
<b>Total</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>7618</b>	<b>7618</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>7696</b>	<b>7696</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6503</b>	<b>6503</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.