

**Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2019**

**Fecha de Información: 01 de agosto 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\$3487.9 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	443.8	547.7	242.8	305.0	187.8	21.6	117.2
15-35	707.5	746.0	637.5	489.0	64.5	174.5	44.0
36-60	111.1	71.1	7.0	20.0	64.1	91.1	0.0
61-90	288.9	356.7	245.0	150.0	1.7	28.9	110.0
91-180	142.5	245.6	150.0	0.0	5.6	52.5	90.0
>180	72.6	145.4	110.0	30.4	5.4	12.2	30.0
<b>Total</b>	<b>1766.5</b>	<b>2112.6</b>	<b>1392.3</b>	<b>994.4</b>	<b>329.2</b>	<b>380.9</b>	<b>391.2</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 %	2.9 %	1.8 %	2.4 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	2.3 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.5 %</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.

<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	29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	14	121	5601	5804	19	185	4495	4666	18	128	4164	4089
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2846	2440	0	0	2507	1806	0	0	2094	1298
<b>Otros</b>	121	14	1101	1303	185	19	467	997	128	18	906	1777
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>9547</b>	<b>9547</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>7469</b>	<b>7469</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7165</b>	<b>7165</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.