

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2019

Fecha de Información: 16 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\$1780.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	438.6	220.4	83.5	306.5	27.9	23.1	109.0
15-35	434.7	591.1	357.5	196.1	121.2	126.1	112.4
36-60	38.1	2.3	0.0	0.0	2.3	38.1	0.0
61-90	97.0	201.2	105.0	8.7	11.2	3.3	85.0
91-180	0.3	10.7	0.0	0.0	10.7	0.3	0.0
>180	43.2	9.6	0.0	1.0	9.6	42.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1051.8</b>	<b>1035.3</b>	<b>546.0</b>	<b>512.4</b>	<b>182.9</b>	<b>233.1</b>	<b>306.4</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	Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	2.2 %	2.4 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.6 %	2.6 %
36-60	-	3.0 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.4 %	2.5 %	0.2 %	2.4 %
91-180	-	2.6 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.3 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.4 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . 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>	25	119	4837	5175	61	135	3162	3468	13	90	3056	4126
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2299	1696	0	0	1927	1137	0	0	2253	932
<b>Otros</b>	119	25	1389	1655	135	61	529	1013	90	13	776	1026
<b>Total</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>8526</b>	<b>8526</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>5618</b>	<b>5618</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>6084</b>	<b>6084</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.