

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2019

Fecha de Información: 18 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\$2378.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	409.4	271.7	45.0	289.0	126.7	20.4	100.0
15-35	793.2	767.1	437.0	353.5	53.5	163.1	276.6
36-60	80.3	17.5	0.0	0.0	17.5	80.3	0.0
61-90	109.0	130.3	7.9	0.0	122.4	109.0	0.0
91-180	28.9	59.5	10.0	20.0	44.5	3.9	5.0
>180	50.2	83.2	30.0	10.0	13.2	0.2	40.0
<b>Total</b>	<b>1471.0</b>	<b>1329.3</b>	<b>529.9</b>	<b>672.5</b>	<b>377.8</b>	<b>376.9</b>	<b>421.6</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	2.6 %	2.5 %	1.8 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.2 %	2.5 %	2.4 %
36-60	-	2.9 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.6 %	1.6 %	2.3 %
>180	2.2 %	2.5 %	1.4 %	2.3 %
<b>Total</b>	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %

\*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>	27	121	5210	5278	62	139	3677	3910	13	100	3635	4685
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2384	2050	0	0	2102	1394	0	0	2419	1121
<b>Otros</b>	121	27	1402	1664	139	62	618	1094	100	13	888	1136
<b>Total</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>8996</b>	<b>8991</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>6397</b>	<b>6397</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>6942</b>	<b>6942</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.