

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2019

Fecha de Información: 09 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\$1567.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	513.1	353.9	127.6	270.7	23.3	39.4	203.0
15-35	312.0	493.7	353.2	157.5	11.1	25.1	129.4
36-60	86.9	6.4	0.0	0.0	6.4	86.9	0.0
61-90	28.7	81.0	70.0	4.3	6.0	19.4	5.0
91-180	5.4	5.7	0.0	0.0	5.7	5.4	0.0
>180	7.8	10.3	0.0	0.0	10.3	7.8	0.0
<b>Total</b>	<b>953.9</b>	<b>951.0</b>	<b>550.8</b>	<b>432.5</b>	<b>62.8</b>	<b>184.0</b>	<b>337.4</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	2.5 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.9 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.5 %	2.5 %	2.4 %	2.5 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
>180	-	2.7 %	2.1 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</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	5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	197	4901	4941	28	124	5039	5497	13	138	3114	3421
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2695	2122	0	0	2718	1747	0	0	1681	1162
<b>Otros</b>	197	19	493	1026	124	28	1357	1870	138	13	628	840
<b>Total</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>8089</b>	<b>8089</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9114</b>	<b>9114</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>5423</b>	<b>5423</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.