

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2019

Fecha de Información: 13 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\$2285.3 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	588.8	131.8	31.2	486.4	33.4	35.2	67.2
15-35	718.6	991.8	646.2	337.5	104.9	140.4	240.7
36-60	12.0	36.1	30.0	0.0	6.1	12.0	0.0
61-90	5.6	4.8	0.0	0.0	4.8	5.6	0.0
91-180	46.9	15.3	0.0	0.0	15.3	46.9	0.0
>180	12.1	29.2	25.0	10.0	4.2	2.1	0.0
<b>Total</b>	<b>1384.1</b>	<b>1209.1</b>	<b>732.4</b>	<b>833.9</b>	<b>168.8</b>	<b>242.3</b>	<b>307.9</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	2.8 %	3.0 %	2.0 %	2.2 %
15-35	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.3 %	1.7 %	1.9 %
61-90	-	2.6 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.7 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.6 %	2.3 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.3 %</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	12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	135	5976	5995	14	140	3404	3615	19	212	3788	4571
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2942	2394	0	0	1696	1164	0	0	2978	1820
<b>Otros</b>	135	26	1394	1924	140	14	731	1051	212	19	798	1173
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>10313</b>	<b>10313</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>5830</b>	<b>5830</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>7564</b>	<b>7564</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.