

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2019

Fecha de Información: 14 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\$1780.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.<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	304.3	152.1	67.0	158.5	20.6	81.2	64.5
15-35	628.5	707.2	281.0	188.0	127.8	142.1	298.4
36-60	72.9	110.6	40.0	0.0	70.6	72.9	0.0
61-90	7.8	7.1	0.0	0.0	7.1	7.8	0.0
91-180	67.8	44.1	15.0	36.2	14.1	16.6	15.0
>180	43.1	22.8	10.0	21.4	2.8	11.6	10.0
<b>Total</b>	<b>1124.3</b>	<b>1043.8</b>	<b>413.0</b>	<b>404.2</b>	<b>242.9</b>	<b>332.2</b>	<b>387.9</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	2.7 %	2.1 %	2.4 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	2.3 %	2.5 %
91-180	2.5 %	2.8 %	2.0 %	2.4 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.6 %</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>	25	135	6187	6110	15	141	3460	3647	20	211	3926	4614
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3009	2553	0	0	1696	1164	0	0	2978	1873
<b>Otros</b>	135	25	1403	1937	141	15	737	1082	211	20	806	1223
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>10600</b>	<b>10600</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>5893</b>	<b>5893</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>7710</b>	<b>7710</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.