

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1689.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	333.1	327.6	87.0	202.5	171.2	61.1	69.5
15-35	460.3	520.7	293.9	134.0	82.7	182.1	144.1
36-60	49.2	56.6	0.0	0.0	56.6	49.2	0.0
61-90	17.2	45.4	30.0	0.0	15.4	17.2	0.0
91-180	22.0	21.3	0.0	0.0	11.3	12.0	10.0
>180	53.2	56.2	0.0	0.0	6.2	3.2	50.0
<b>Total</b>	<b>934.9</b>	<b>1027.9</b>	<b>410.9</b>	<b>336.5</b>	<b>343.5</b>	<b>324.9</b>	<b>273.6</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	2.7 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.6 %	2.6 %
36-60	-	2.5 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.5 %	2.9 %	2.3 %	2.6 %
>180	2.5 %	2.7 %	2.3 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.5 %</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>	23	139	6216	6116	17	140	3652	3745	20	211	4043	4837
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3009	2575	0	0	1765	1304	0	0	2996	1913
<b>Otros</b>	139	23	1409	1943	140	17	740	1108	211	20	967	1255
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>10634</b>	<b>10634</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>6157</b>	<b>6157</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>8006</b>	<b>8006</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.