

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1498.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.<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	310.2	206.0	6.4	136.4	39.6	13.8	160.0
15-35	650.2	587.5	186.0	141.1	98.5	206.0	303.0
36-60	48.6	45.1	0.0	0.0	5.1	8.6	40.0
61-90	2.4	5.3	0.0	0.0	5.3	2.4	0.0
91-180	1.0	15.5	0.0	0.0	15.5	1.0	0.0
>180	126.0	73.8	0.0	50.0	3.8	6.0	70.0
<b>Total</b>	<b>1138.3</b>	<b>933.3</b>	<b>192.4</b>	<b>327.5</b>	<b>167.8</b>	<b>237.7</b>	<b>573.0</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 %	2.7 %	1.5 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
36-60	2.4 %	3.0 %	2.3 %	2.5 %
61-90	-	2.8 %	2.2 %	2.6 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.8 %
>180	2.5 %	3.0 %	2.6 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.4 %</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	19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	47	197	4464	4305	27	221	4810	5287	11	66	3350	3858
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1916	1781	0	0	3043	2276	0	0	2500	1562
<b>Otros</b>	197	47	807	1102	221	27	1044	1334	66	11	498	928
<b>Total</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>7188</b>	<b>7188</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>8897</b>	<b>8897</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>6349</b>	<b>6349</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.