

**Fecha de Publicación: 19 de julio de 2019**

**Fecha de Información: 17 de julio 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\$2769.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

| Rango        | Sector Financiero** |               | Intragrupo y Off-shore*** |              | Otros Agentes |              | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas        | Compras                   | Ventas       | Compras       | Ventas       |                |
| 3-14         | 741.8               | 458.1         | 114.0                     | 380.8        | 103.1         | 120.0        | 2411.0         |
| 15-35        | 1000.5              | 1152.9        | 376.0                     | 163.0        | 93.9          | 154.5        | 683.0          |
| 36-60        | 140.2               | 88.2          | 0.0                       | 0.0          | 88.2          | 140.2        | 0.0            |
| 61-90        | 10.4                | 50.1          | 10.0                      | 0.0          | 30.1          | 0.4          | 10.0           |
| 91-180       | 10.1                | 32.6          | 2.0                       | 0.0          | 20.6          | 0.1          | 10.0           |
| >180         | 11.3                | 17.2          | 0.0                       | 10.1         | 17.2          | 1.2          | 0.0            |
| <b>Total</b> | <b>1914.3</b>       | <b>1799.2</b> | <b>502.0</b>              | <b>553.9</b> | <b>353.2</b>  | <b>416.4</b> | <b>944.0</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       |              |
| 3-14         | 2.6 %              | 2.7 %                        | 2.1 %        | 2.4 %        |
| 15-35        | 2.6 %              | 2.5 %                        | 2.6 %        | 2.6 %        |
| 36-60        | -                  | 2.6 %                        | 2.5 %        | 2.5 %        |
| 61-90        | 2.4 %              | 2.6 %                        | 2.0 %        | 2.6 %        |
| 91-180       | 2.4 %              | 2.6 %                        | 2.1 %        | 2.6 %        |
| >180         | -                  | 2.5 %                        | 2.2 %        | 2.5 %        |
| <b>Total</b> | <b>2.3 %</b>       | <b>2.6 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

| Sectores                         | 15 al 19 de julio |            |             |             | 22 al 26 de julio |            |             |             | 29 de jul. al 2 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                | 123        | 5130        | 5263        | 61                | 138        | 3552        | 3871        | 13                        | 92         | 3417        | 4392        |
| <b>Intragrupo y off-shore***</b> | 0                 | 0          | 2381        | 1970        | 0                 | 0          | 2072        | 1273        | 0                         | 0          | 2328        | 1032        |
| Otros                            | 123               | 26         | 1390        | 1664        | 138               | 61         | 609         | 1089        | 92                        | 13         | 792         | 1115        |
| <b>Total</b>                     | <b>148</b>        | <b>148</b> | <b>8902</b> | <b>8897</b> | <b>199</b>        | <b>199</b> | <b>6233</b> | <b>6233</b> | <b>104</b>                | <b>104</b> | <b>6538</b> | <b>6538</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.