

**Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2019**

**Fecha de Información: 12 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\$1524.4 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	244.6	168.1	58.9	115.9	13.2	32.7	96.0
15-35	516.6	514.5	422.0	319.3	19.5	124.3	73.0
36-60	23.0	154.0	140.0	0.0	14.0	23.0	0.0
61-90	12.6	0.7	0.0	0.0	0.7	12.6	0.0
91-180	4.7	31.9	20.0	0.0	11.9	4.7	0.0
>180	22.5	0.2	0.0	10.0	0.2	12.5	0.0
<b>Total</b>	<b>824.0</b>	<b>869.4</b>	<b>640.9</b>	<b>445.2</b>	<b>59.5</b>	<b>209.8</b>	<b>169.0</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 %	2.8 %	1.7 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.7 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	2.4 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.2 %	2.5 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.2 %</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	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	131	5417	5905	13	138	3377	3580	19	211	3689	4504
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2916	1910	0	0	1691	1162	0	0	2955	1767
<b>Otros</b>	131	26	1387	1904	138	13	711	1037	211	19	792	1165
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>9720</b>	<b>9720</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>5779</b>	<b>5779</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>7436</b>	<b>7436</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.