

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 17 de septiembre 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\$1354.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	530.7	220.0	47.4	375.6	28.6	11.1	144.0
15-35	399.2	334.5	130.0	123.0	48.5	120.3	156.0
36-60	13.4	58.5	52.1	0.0	6.4	13.4	0.0
61-90	3.8	5.5	3.4	0.0	2.1	3.8	0.0
91-180	23.9	43.1	0.0	0.0	28.1	8.9	15.0
>180	34.8	31.8	0.0	0.0	1.8	4.8	30.0
<b>Total</b>	<b>1005.8</b>	<b>693.4</b>	<b>233.0</b>	<b>498.6</b>	<b>115.5</b>	<b>162.3</b>	<b>345.0</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	1.3 %	1.4 %	1.0 %	1.2 %
15-35	1.2 %	1.3 %	1.2 %	1.2 %
36-60	-	1.6 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	2.0 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.7 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.4 %	2.1 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.3 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
Vencimientos de Forwards

Sector	16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	150	7911	6970	19	127	4011	4544	15	160	2443	2721
Intragrupa y off-shore***	0	0	2730	3010	0	0	1927	1399	0	0	1131	852
Otros	150	30	1724	2385	127	19	926	921	160	15	456	457
<b>Total</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>12365</b>	<b>12365</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6865</b>	<b>6865</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>4031</b>	<b>4031</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.

<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.