

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 09 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\$1629.8 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	442.1	254.4	94.0	274.0	18.0	25.6	142.5
15-35	319.5	565.1	337.2	100.7	23.9	14.8	204.0
36-60	128.4	85.9	0.0	44.4	75.9	74.0	10.0
61-90	9.4	7.4	0.0	0.0	7.4	9.4	0.0
91-180	27.3	49.5	0.0	26.0	49.5	1.3	0.0
>180	38.9	78.3	30.8	0.0	27.5	18.9	20.0
<b>Total</b>	<b>965.7</b>	<b>1040.6</b>	<b>462.0</b>	<b>445.1</b>	<b>202.1</b>	<b>144.1</b>	<b>376.5</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	1.1 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	1.5 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
91-180	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</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	9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	167	5842	5462	22	150	6316	5830	17	128	3440	4020
Intragrupa y off-shore***	0	0	2991	2532	0	0	2163	1962	0	0	1703	1085
Otros	167	24	956	1795	150	22	1573	2259	128	17	831	868
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>9789</b>	<b>9789</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>10052</b>	<b>10052</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>5974</b>	<b>5974</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.