

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 13 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\$1903.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	373.0	647.8	523.5	255.4	38.5	31.9	85.7
15-35	437.8	366.2	173.4	289.2	64.1	19.9	128.7
36-60	5.4	10.6	0.0	0.0	10.6	5.4	0.0
61-90	3.7	21.3	0.0	0.0	20.3	2.7	1.0
91-180	200.7	23.0	0.0	200.0	23.0	0.7	0.0
>180	20.9	18.9	5.5	10.0	3.4	0.9	10.0
<b>Total</b>	<b>1041.5</b>	<b>1087.7</b>	<b>702.5</b>	<b>754.7</b>	<b>159.9</b>	<b>61.5</b>	<b>225.4</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 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.7 %
61-90	1.5 %	2.0 %	1.5 %	1.9 %
91-180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.7 %	2.0 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</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	121	6445	6103	26	149	7329	6732	18	126	3677	4421
Intragrupa y off-shore***	0	0	3446	2939	0	0	2671	2579	0	0	1907	1153
Otros	121	24	973	1821	149	26	1694	2383	125	18	897	907
<b>Total</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>10864</b>	<b>10864</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>11694</b>	<b>11694</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>6481</b>	<b>6481</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.