

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2019

Fecha de Información: 08 de octubre 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\$1622.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	323.5	402.3	187.8	133.5	114.6	90.0	100.0
15-35	505.9	400.0	181.5	262.4	79.5	104.5	139.0
36-60	21.3	38.3	0.0	0.0	27.3	10.3	11.0
61-90	13.4	6.8	0.0	0.0	6.2	12.8	0.6
91-180	28.5	30.5	0.2	10.0	15.3	3.5	15.0
>180	30.4	107.5	70.0	0.0	17.5	10.4	20.0
<b>Total</b>	<b>923.0</b>	<b>985.4</b>	<b>439.5</b>	<b>405.9</b>	<b>260.3</b>	<b>231.4</b>	<b>285.6</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	1.5 %	1.7 %	1.8 %	1.7 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.4 %	2.1 %	1.4 %	1.8 %
61-90	1.5 %	2.3 %	1.5 %	1.8 %
91-180	1.6 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	32	150	5330	5337	22	96	2491	2507	9	117	2777	2948
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2494	2088	0	0	979	809	0	0	1124	866
<b>Otros</b>	150	32	1317	1716	96	22	662	817	117	9	537	624
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>9141</b>	<b>9141</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>4132</b>	<b>4132</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4439</b>	<b>4439</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.