

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 05 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\$1467.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	339.6	309.8	217.0	265.2	42.8	24.3	50.0
15-35	362.7	280.5	137.8	210.3	67.7	77.4	75.0
36-60	6.9	16.0	0.0	0.0	16.0	6.9	0.0
61-90	26.7	66.8	19.6	0.0	27.3	6.7	20.0
91-180	85.7	29.6	10.0	80.0	19.6	5.7	0.0
>180	56.7	56.8	28.5	31.6	3.3	0.1	25.0
<b>Total</b>	<b>878.2</b>	<b>759.5</b>	<b>412.9</b>	<b>587.1</b>	<b>176.6</b>	<b>121.1</b>	<b>170.0</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	1.5 %	1.5 %	1.0 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
61-90	1.7 %	2.2 %	0.2 %	1.8 %
91-180	-	2.3 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.5 %</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	2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	83	5097	4902	20	155	5391	5078	19	145	6041	5595
Intragrupa y off-shore***	0	0	2899	2603	0	0	2675	2140	0	0	2126	1896
Otros	83	23	647	1138	155	20	932	1780	145	19	1564	2239
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>8643</b>	<b>8643</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>8998</b>	<b>8998</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>9730</b>	<b>9730</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.