

**Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2019**

**Fecha de Información: 06 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\$1716.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	284.4	379.2	259.1	184.4	31.1	11.0	89.0
15-35	533.9	331.5	217.0	399.2	56.5	76.7	58.0
36-60	114.8	20.9	0.0	87.1	20.9	27.7	0.0
61-90	55.7	55.1	0.5	20.0	19.6	0.7	35.0
91-180	1.2	68.4	1.2	0.0	67.2	1.2	0.0
>180	41.4	31.7	4.4	18.3	7.3	3.0	20.0
<b>Total</b>	<b>1031.3</b>	<b>886.8</b>	<b>482.2</b>	<b>709.0</b>	<b>202.6</b>	<b>120.3</b>	<b>202.0</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	
3-14	1.4 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	2.8 %	1.4 %	1.8 %
61-90	1.8 %	2.3 %	1.6 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	1.7 %	2.3 %
>180	2.1 %	2.8 %	2.4 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.3 %</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.

<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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	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
<b>Sector Financiero**</b>	23	82	5102	4902	23	161	5551	5357	19	148	6175	5690
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2899	2603	0	0	2932	2283	0	0	2128	1937
Otros	82	23	648	1143	161	23	948	1790	148	19	1573	2249
Total	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>8649</b>	<b>8649</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>9430</b>	<b>9430</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>9876</b>	<b>9876</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.