

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1747.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.<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	602.4	409.0	125.4	314.0	23.7	28.5	260.0
15-35	338.2	308.3	203.8	195.3	73.4	111.9	31.1
36-60	106.5	112.9	48.9	48.8	64.0	57.8	0.0
61-90	9.0	14.2	0.0	0.0	14.2	9.0	0.0
91-180	55.9	38.5	0.0	10.0	38.5	45.9	0.0
>180	21.5	21.7	20.0	20.0	1.7	1.5	0.0
<b>Total</b>	<b>1133.6</b>	<b>904.8</b>	<b>398.1</b>	<b>588.0</b>	<b>215.6</b>	<b>254.6</b>	<b>291.1</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 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
15-35	1.1 %	1.0 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.4 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
>180	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.1 %</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**

Sectores	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**	25	174	6224	5692	25	148	6488	5957	18	128	3504	4123
Intragrupo y off-shore***	0	0	3101	2795	0	0	2172	2012	0	0	1748	1100
Otros	174	25	972	1810	148	25	1575	2266	128	18	847	876
<b>Total</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>10297</b>	<b>10297</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>10235</b>	<b>10235</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6099</b>	<b>6099</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ { (360 / \text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.