

**Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2019**

**Fecha de Información: 11 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\$2026.1 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	349.1	300.0	103.0	144.0	98.4	106.5	98.7
15-35	704.7	802.6	386.5	220.8	33.3	101.1	382.9
36-60	122.2	33.3	0.0	0.0	13.3	102.2	20.0
61-90	0.6	15.1	0.0	0.0	15.1	0.6	0.0
91-180	127.9	98.2	20.0	40.0	8.2	17.9	70.0
>180	31.9	21.9	0.0	20.0	11.9	1.9	10.0
<b>Total</b>	<b>1336.5</b>	<b>1271.1</b>	<b>509.5</b>	<b>424.8</b>	<b>180.1</b>	<b>330.2</b>	<b>581.5</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	1.3 %	1.0 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.6 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	3.0 %	0.8 %	2.9 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</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.

**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	118	6333	5939	26	147	6738	6105	18	127	3618	4320
Intragrupo y off-shore***	0	0	3306	2852	0	0	2180	2119	0	0	1867	1133
Otros	118	25	972	1820	147	26	1669	2363	127	18	848	880
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>10611</b>	<b>10611</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>10587</b>	<b>10587</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>6334</b>	<b>6334</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.