

**Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2019**

**Fecha de Información: 27 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\$966.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	229.6	275.6	138.0	93.4	34.1	32.7	103.5
15-35	110.0	288.8	160.4	36.5	99.8	44.9	28.6
36-60	25.9	11.7	0.0	1.3	11.7	24.6	0.0
61-90	46.8	40.5	0.0	0.0	30.5	36.8	10.0
91-180	17.5	14.0	0.0	0.0	4.0	7.5	10.0
>180	49.8	23.6	0.0	30.9	8.6	3.9	15.0
<b>Total</b>	<b>479.5</b>	<b>654.2</b>	<b>298.4</b>	<b>162.1</b>	<b>188.7</b>	<b>150.3</b>	<b>167.1</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	2.1 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	0.8 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.8 %	1.4 %	1.6 %	1.5 %
91-180	1.8 %	2.3 %	1.6 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.3 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.6 %</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 intragruppo.

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

Sectores	23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	151	5349	5157	34	99	3274	3720	22	140	4152	3774
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2189	2349	0	0	1507	1073	0	0	1869	1573
<b>Otros</b>	151	18	1093	1125	99	34	711	700	140	22	812	1485
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>8631</b>	<b>8631</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5493</b>	<b>5493</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6832</b>	<b>6832</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.