

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 24 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\$1342.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	136.7	268.0	168.0	32.0	11.2	15.9	88.8
15-35	466.4	384.6	125.0	172.0	59.0	93.7	200.7
36-60	79.1	65.1	0.0	0.0	55.1	69.1	10.0
61-90	84.1	24.3	10.0	10.0	9.3	69.1	5.0
91-180	2.9	7.6	0.0	0.0	7.6	2.9	0.0
>180	93.2	46.9	33.0	63.0	1.9	18.2	12.0
<b>Total</b>	<b>862.4</b>	<b>796.5</b>	<b>336.0</b>	<b>277.0</b>	<b>144.1</b>	<b>269.0</b>	<b>316.5</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	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.7 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	1.8 %	2.2 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	2.1 %	1.5 %	1.9 %
>180	2.4 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.5 %</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.

**Cuadro No. 3**  
Vencimientos de Forwards

Sector	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
Sector Financiero**	20	143	5106	5024	20	96	2776	3170	13	138	3993	3497
Intragrupa y off-shore***	0	0	2126	2171	0	0	1251	875	0	0	1735	1592
Otros	143	20	1068	1104	96	20	545	527	138	13	800	1440
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>8300</b>	<b>8300</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>4572</b>	<b>4572</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>6529</b>	<b>6529</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.