

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 25 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\$1442.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	286.6	267.1	178.0	174.4	7.3	30.4	81.8
15-35	370.3	481.1	249.9	153.0	25.2	11.3	206.0
36-60	48.4	41.0	0.0	0.0	41.0	48.4	0.0
61-90	169.3	114.8	20.0	35.0	1.8	41.3	93.0
91-180	19.2	5.9	0.0	0.0	5.9	19.2	0.0
>180	10.8	13.6	0.0	0.0	8.6	5.8	5.0
<b>Total</b>	<b>904.5</b>	<b>923.6</b>	<b>447.9</b>	<b>362.4</b>	<b>89.8</b>	<b>156.3</b>	<b>385.8</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	1.7 %	1.2 %	0.8 %	1.2 %
15-35	1.7 %	1.6 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	2.5 %	1.3 %	1.6 %
>180	2.0 %	2.6 %	1.9 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.5 %</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>	20	148	5279	5125	22	95	2880	3280	13	138	4083	3665
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2156	2279	0	0	1333	938	0	0	1846	1605
<b>Otros</b>	148	20	1098	1128	95	22	547	542	138	13	792	1451
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>8532</b>	<b>8532</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>4760</b>	<b>4760</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6721</b>	<b>6721</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.