

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 29 de noviembre 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\$2633.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	348.6	425.1	248.0	138.0	47.1	80.6	130.0
15-35	735.6	730.5	354.6	288.3	57.4	128.8	318.5
36-60	24.0	48.5	0.0	0.0	48.5	24.0	0.0
61-90	256.1	334.7	120.0	0.0	77.7	119.1	137.0
91-180	78.4	63.5	0.0	2.4	48.5	61.0	15.0
>180	105.4	102.8	70.0	39.6	13.8	46.8	19.0
<b>Total</b>	<b>1548.0</b>	<b>1705.0</b>	<b>792.6</b>	<b>468.3</b>	<b>292.9</b>	<b>460.2</b>	<b>619.5</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	2.2 %	2.0 %	2.1 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
36-60	-	2.3 %	1.9 %	2.2 %
61-90	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
>180	2.4 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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	25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	44	211	6017	5382	75	116	3683	3998	26	134	4010	4755
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1988	2803	0	0	1870	1716	0	0	2524	1347
<b>Otros</b>	211	44	1364	1184	116	75	1214	1054	134	26	926	1350
<b>Total</b>	<b>255</b>	<b>255</b>	<b>9369</b>	<b>9369</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>6768</b>	<b>6768</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>7460</b>	<b>7452</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.