

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 09 de diciembre 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\$2281.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	387.9	353.0	182.5	254.8	58.0	20.6	112.5
15-35	383.8	587.3	402.3	184.2	7.6	22.1	177.5
36-60	173.2	60.2	10.0	0.0	8.7	131.7	41.5
61-90	239.8	72.5	0.0	0.0	72.5	239.8	0.0
91-180	51.8	63.6	0.3	20.0	33.4	1.8	30.0
>180	184.2	86.0	73.0	170.0	13.0	14.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1420.7</b>	<b>1222.6</b>	<b>668.0</b>	<b>629.0</b>	<b>193.1</b>	<b>430.2</b>	<b>361.5</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	2.5 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.3 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.1 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
61-90	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.1 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
>180	-	2.4 %	2.5 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.3 %</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	33	139	5302	6020	89	212	4738	5573	13	129	2800	3798
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3072	2109	0	0	3190	2512	0	0	2521	1526
<b>Otros</b>	139	33	1267	1504	212	89	1074	916	129	13	304	296
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>9641</b>	<b>9633</b>	<b>301</b>	<b>301</b>	<b>9001</b>	<b>9001</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5624</b>	<b>5619</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.