

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 11 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\$2772.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	691.1	384.0	173.5	529.0	60.5	12.1	150.0
15-35	597.2	550.1	350.9	408.3	86.7	76.4	112.5
36-60	18.7	87.1	40.0	0.0	47.1	18.7	0.0
61-90	193.1	167.4	30.0	0.0	137.4	193.1	0.0
91-180	101.5	104.1	30.0	30.3	71.1	68.2	3.0
>180	38.0	125.8	80.0	0.0	25.8	18.0	20.0
<b>Total</b>	<b>1639.6</b>	<b>1418.5</b>	<b>704.4</b>	<b>967.6</b>	<b>428.6</b>	<b>386.5</b>	<b>285.5</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	2.0 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	1.6 %	2.1 %
61-90	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
91-180	1.9 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.5 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</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	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>	35	144	6009	6299	91	215	5358	6040	13	128	2943	3855
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	3220	2703	0	0	3418	2894	0	0	2521	1634
<b>Otros</b>	144	35	1288	1507	215	91	1250	1092	128	13	339	311
<b>Total</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>10517</b>	<b>10509</b>	<b>306</b>	<b>306</b>	<b>10026</b>	<b>10026</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5804</b>	<b>5799</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.