

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 07 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\$2103.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	408.1	330.2	169.0	280.0	68.6	35.5	92.6
15-35	648.9	654.2	340.0	337.7	160.2	157.2	154.0
36-60	3.7	14.2	0.0	0.0	14.2	3.7	0.0
61-90	55.2	41.7	0.0	0.0	40.7	54.2	1.0
91-180	50.4	10.5	0.0	0.0	10.5	50.4	0.0
>180	95.4	109.1	30.0	20.0	9.1	5.4	70.0
<b>Total</b>	<b>1261.7</b>	<b>1159.8</b>	<b>539.0</b>	<b>637.7</b>	<b>303.2</b>	<b>306.4</b>	<b>317.6</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	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
36-60	-	1.6 %	1.2 %	1.5 %
61-90	1.3 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.3 %	2.0 %	2.2 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.3 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	38	112	4119	3865	36	142	3402	3253	29	176	2759	2900
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1723	1835	0	0	1270	1085	0	0	1190	1099
<b>Otros</b>	112	38	697	839	142	36	962	1296	176	29	1079	1029
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>6539</b>	<b>6539</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>5634</b>	<b>5634</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>5028</b>	<b>5028</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.