**Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2019**

**Fecha de Información: 19 de noviembre de 2019** [1]

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$2295.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.[2]

**Cuadro No. 1**
**Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 522.3 | 390.8 | 164.5 | 271.0 | 83.3 | 108.3 | 143.0 |
| 15-35 | 389.0 | 884.2 | 690.3 | 183.8 | 37.4 | 48.7 | 156.5 |
| 36-60 | 90.5 | 100.0 | 10.0 | 0.0 | 23.0 | 23.5 | 67.0 |
| 61-90 | 0.7 | 29.7 | 0.0 | 0.0 | 29.7 | 0.7 | 0.0 |
| 91-180 | 110.5 | 45.0 | 0.1 | 100.0 | 34.9 | 0.5 | 10.0 |
| >180 | 73.1 | 63.2 | 35.0 | 35.4 | 1.2 | 10.7 | 27.0 |
| **Total** | **1186.2** | **1512.8** | **899.9** | **590.2** | **209.5** | **192.5** | **403.5** |

* 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 | 1.9 % | 1.6 % | 1.3 % | 1.5 % |
| 15-35 | 1.9 % | 1.8 % | 5.7 % | 2.6 % |
| 36-60 | 1.7 % | 1.8 % | 1.6 % | 1.7 % |
| 61-90 | - | 1.8 % | 1.5 % | 1.8 % |
| 91-180 | 1.7 % | 2.0 % | 1.7 % | 1.8 % |
| >180 | 2.3 % | 4.4 % | 2.3 % | 3.0 % |
| **Total** | 1.9 % | 1.8 % | 2.7 % | 2.1 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

[1] Datos provisionales.

[2] 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 | 18 al 22 de noviembre | | | | 25 al 29 de noviembre | | | | 2 al 6 de diciembre | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| **Sector Financiero**** | 43 | 233 | 3985 | 4042 | 34 | 182 | 4165 | 4278 | 18 | 105 | 3113 | 3113 |
| **Intragrupo y off-shore***** | 0 | 0 | 1782 | 1735 | 0 | 0 | 1540 | 1273 | 0 | 0 | 1363 | 1453 |
| **Otros** | 233 | 43 | 1128 | 1118 | 182 | 34 | 975 | 1129 | 105 | 18 | 992 | 903 |
| **Total** | **276** | **276** | **6895** | **6895** | **215** | **215** | **6681** | **6681** | **124** | **124** | **5469** | **5469** |

* 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.