

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 04 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\$2240.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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         | 457.7               | 204.0         | 67.2                      | 350.7        | 63.2          | 33.4         | 73.6           |
| 15-35        | 398.4               | 379.9         | 316.3                     | 355.0        | 26.8          | 6.6          | 36.9           |
| 36-60        | 26.6                | 29.4          | 1.5                       | 0.0          | 27.9          | 26.6         | 0.0            |
| 61-90        | 245.7               | 274.2         | 10.0                      | 0.0          | 235.2         | 216.7        | 29.0           |
| 91-180       | 10.5                | 194.1         | 130.0                     | 10.0         | 64.1          | 0.5          | 0.0            |
| >180         | 29.4                | 130.3         | 110.0                     | 20.0         | 20.3          | 9.4          | 0.0            |
| <b>Total</b> | <b>1168.3</b>       | <b>1211.9</b> | <b>635.0</b>              | <b>735.7</b> | <b>437.5</b>  | <b>293.1</b> | <b>139.5</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         | 2.6 %              | 2.5 %                        | 2.4 %        | 2.4 %        |
| 15-35        | 2.3 %              | 2.4 %                        | 2.3 %        | 2.3 %        |
| 36-60        | -                  | 3.4 %                        | 2.1 %        | 2.7 %        |
| 61-90        | 2.1 %              | 2.2 %                        | 2.1 %        | 2.1 %        |
| 91-180       | -                  | 2.3 %                        | 1.9 %        | 2.3 %        |
| >180         | -                  | 2.5 %                        | 2.4 %        | 2.4 %        |
| <b>Total</b> | <b>2.4 %</b>       | <b>2.4 %</b>                 | <b>2.3 %</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.

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

| Sector                           | 2 al 6 de diciembre |            |             |             | 9 al 13 de diciembre |            |             |             | 16 al 20 de diciembre |            |             |             |
|----------------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
|                                  | Delivery            |            | NDF         |             | Delivery             |            | NDF         |             | Delivery              |            | NDF         |             |
|                                  | C                   | V          | C           | V           | C                    | V          | C           | V           | C                     | V          | C           | V           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 72                  | 129        | 4342        | 4608        | 30                   | 140        | 4351        | 5207        | 85                    | 207        | 4364        | 4670        |
| <b>Intragrupa y off-shore***</b> | 0                   | 0          | 2347        | 2168        | 0                    | 0          | 2643        | 1471        | 0                     | 0          | 2730        | 2329        |
| <b>Otros</b>                     | 129                 | 72         | 1172        | 1084        | 140                  | 30         | 1143        | 1452        | 207                   | 85         | 792         | 887         |
| <b>Total</b>                     | <b>201</b>          | <b>201</b> | <b>7860</b> | <b>7860</b> | <b>170</b>           | <b>170</b> | <b>8138</b> | <b>8130</b> | <b>292</b>            | <b>292</b> | <b>7885</b> | <b>7885</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.