

**Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2019**

**Fecha de Información: 22 de octubre 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\$1372.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	432.8	271.9	61.0	223.8	12.9	11.0	198.0
15-35	407.6	330.0	120.5	196.8	109.5	110.9	100.0
36-60	65.5	35.8	0.4	0.0	35.4	65.5	0.0
61-90	6.3	5.8	0.0	0.0	5.8	6.3	0.0
91-180	5.7	32.5	15.0	0.0	17.5	5.7	0.0
>180	24.0	53.0	50.0	20.5	3.0	3.5	0.0
<b>Total</b>	<b>941.8</b>	<b>729.1</b>	<b>246.9</b>	<b>441.1</b>	<b>184.2</b>	<b>202.8</b>	<b>298.0</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	
3-14	0.9 %	1.1 %	0.8 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	1.4 %	0.9 %	1.1 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.7 %
>180	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>0.9 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>0.9 %</b>	<b>1.0 %</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	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	129	4006	3720	50	113	3149	3649	18	86	2555	2449
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1355	1497	0	0	1629	993	0	0	1062	1096
<b>Otros</b>	129	24	747	891	113	50	625	761	86	18	467	538
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>6109</b>	<b>6109</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5403</b>	<b>5403</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4083</b>	<b>4083</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.