

**Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2019**

**Fecha de Información: 13 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\$2980.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	236.8	199.0	128.0	148.1	56.8	74.5	14.2
15-35	706.6	779.5	461.3	306.8	114.3	195.8	204.0
36-60	22.2	139.8	120.0	15.0	19.8	7.2	0.0
61-90	318.9	63.3	3.1	185.0	39.8	113.6	20.3
91-180	209.4	314.4	225.0	94.0	12.5	38.5	76.9
>180	165.6	160.1	119.0	123.0	21.1	22.6	20.0
<b>Total</b>	<b>1659.3</b>	<b>1656.1</b>	<b>1056.4</b>	<b>871.9</b>	<b>264.3</b>	<b>452.1</b>	<b>335.4</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	1.7 %	1.6 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
61-90	1.6 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.0 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</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	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	44	199	4267	4337	36	177	2964	3273	25	177	3882	3753
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1545	1777	0	0	1428	1140	0	0	1371	1239
<b>Otros</b>	199	44	1646	1344	177	36	1114	1092	177	25	827	1088
<b>Total</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>7458</b>	<b>7458</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>5505</b>	<b>5505</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>6080</b>	<b>6080</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.