

**Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2019**

**Fecha de Información: 21 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\$1646.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<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	381.5	344.3	150.7	196.0	98.6	90.5	95.0
15-35	285.3	453.9	382.4	194.4	25.5	44.9	46.0
36-60	38.2	25.9	0.0	0.0	25.9	38.2	0.0
61-90	6.2	6.0	0.0	0.0	6.0	6.2	0.0
91-180	101.5	95.5	50.0	70.0	15.5	1.5	30.0
>180	52.5	26.6	20.0	50.0	6.6	2.5	0.0
<b>Total</b>	<b>865.2</b>	<b>952.4</b>	<b>603.1</b>	<b>510.4</b>	<b>178.3</b>	<b>183.8</b>	<b>171.0</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	2.5 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.2 %	1.6 %	1.9 %
91-180	2.1 %	2.2 %	1.4 %	2.1 %
>180	-	2.3 %	2.3 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</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	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
<b>Sector Financiero**</b>	43	234	4268	4149	41	190	4550	4535	18	105	3260	3414
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1878	2005	0	0	1683	1548	0	0	1534	1468
<b>Otros</b>	234	43	1129	1120	190	41	996	1146	105	18	1075	987
<b>Total</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>7274</b>	<b>7274</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>7229</b>	<b>7229</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5869</b>	<b>5869</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.