

**Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2019**

**Fecha de Información: 02 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\$2656.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	269.1	517.5	338.0	104.0	32.5	18.1	147.0
15-35	850.8	502.3	217.2	562.7	8.2	11.1	277.0
36-60	224.0	216.1	25.0	38.7	95.1	89.3	96.0
61-90	166.1	164.4	0.0	0.0	164.4	166.1	0.0
91-180	45.1	47.3	16.2	20.6	11.1	4.5	20.0
>180	85.4	168.4	106.0	0.0	2.4	25.4	60.0
<b>Total</b>	<b>1640.6</b>	<b>1616.1</b>	<b>702.3</b>	<b>726.0</b>	<b>313.8</b>	<b>314.5</b>	<b>600.0</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 intragruo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %		2.3 %	1.4 %	2.1 %
15-35	2.3 %		2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.1 %		2.1 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-		2.1 %	2.0 %	2.0 %
91-180	2.1 %		2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.4 %		2.3 %	2.5 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</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.

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

Sectores	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>	75	117	3878	4244	26	135	4054	4862	84	206	4297	4583
Intragruo y off-shore***	0	0	1999	1811	0	0	2596	1354	0	0	2681	2291
Otros	117	75	1236	1058	135	26	935	1361	206	84	769	873
<b>Total</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>7113</b>	<b>7113</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>7585</b>	<b>7577</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>7748</b>	<b>7748</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.