

**Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2019**

**Fecha de Información: 18 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\$2253.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	426.3	196.4	78.5	332.5	30.7	6.7	87.2
15-35	841.6	870.1	408.3	458.0	116.3	38.2	345.4
36-60	8.8	37.8	0.0	0.0	37.8	8.8	0.0
61-90	25.1	48.2	0.0	21.7	48.2	3.4	0.0
91-180	6.3	74.5	0.0	0.0	74.5	6.3	0.0
>180	69.8	99.6	10.0	0.0	71.3	51.5	18.3
<b>Total</b>	<b>1378.1</b>	<b>1326.7</b>	<b>496.8</b>	<b>812.1</b>	<b>379.0</b>	<b>115.0</b>	<b>450.9</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 %	1.8 %	2.3 %	2.1 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	2.7 %	1.6 %	2.5 %
61-90	-	2.1 %	1.0 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.8 %	2.2 %
>180	2.4 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</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	16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	94	213	6585	6968	18	151	3805	4261	5	47	2180	2373
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	3923	3849	0	0	2557	2110	0	0	1700	1550
<b>Otros</b>	213	94	1452	1144	151	18	467	453	47	5	138	95
<b>Total</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>11961</b>	<b>11961</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6829</b>	<b>6824</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>4018</b>	<b>4018</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.