

**Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2019**

**Fecha de Información: 24 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\$726.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	75.0	83.4	43.0	39.5	5.4	0.5	35.0
15-35	270.8	211.5	145.0	219.5	16.5	1.3	50.0
36-60	4.5	14.1	0.0	0.0	14.1	4.5	0.0
61-90	70.3	28.9	10.5	70.0	18.4	0.3	0.0
91-180	1.3	21.3	0.0	0.0	21.3	1.3	0.0
>180	3.8	26.5	0.0	0.0	26.5	3.8	0.0
<b>Total</b>	<b>425.7</b>	<b>385.6</b>	<b>198.5</b>	<b>329.0</b>	<b>102.1</b>	<b>11.7</b>	<b>85.0</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 intragrupa		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.3 %	1.0 %	1.5 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
36-60	-	1.8 %	1.2 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.1 %	1.9 %
91-180	-	2.4 %	1.9 %	2.4 %
>180	-	2.4 %	2.1 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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	23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	155	4395	4549	5	48	2387	2559	20	89	3877	3538
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2711	2611	0	0	1773	1640	0	0	2102	2495
<b>Otros</b>	155	19	524	464	48	5	146	100	89	20	398	344
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>7630</b>	<b>7625</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>4305</b>	<b>4299</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>6377</b>	<b>6377</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 intragrupa.