

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 05 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\$2207.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	410.3	397.0	180.0	205.2	35.5	23.6	181.5
15-35	723.1	580.1	278.2	482.2	108.4	47.4	193.5
36-60	13.5	16.6	0.0	0.0	15.6	12.5	1.0
61-90	193.5	103.1	0.0	75.0	103.1	118.5	0.0
91-180	54.6	58.4	30.0	40.0	28.4	14.6	0.0
>180	13.3	19.4	10.0	10.0	9.4	3.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1408.4</b>	<b>1174.6</b>	<b>498.2</b>	<b>812.4</b>	<b>300.4</b>	<b>220.0</b>	<b>376.0</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	Compras	Ventas	
3-14	1.2 %	1.4 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.1 %	1.4 %	1.0 %	1.2 %
36-60	1.4 %	1.8 %	1.1 %	1.5 %
61-90	-	1.3 %	1.2 %	1.2 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.2 %</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	4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	115	3813	3555	25	124	3144	2988	27	170	2620	2706
Intragruppo y off-shore***	0	0	1452	1578	0	0	1113	943	0	0	1113	1050
Otros	115	41	689	821	124	25	921	1247	170	27	986	964
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>5954</b>	<b>5954</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>5178</b>	<b>5178</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>4720</b>	<b>4720</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 intragrupo.