

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2020

Fecha de Información: 08 de enero de 2020 <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\$2797.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	705.9	955.4	246.7	183.5	289.5	103.2	419.3
15-35	624.1	481.8	271.8	361.3	31.0	83.8	179.0
36-60	25.5	85.8	30.0	0.0	45.8	15.5	10.0
61-90	275.2	91.8	0.0	207.0	81.8	58.2	10.0
91-180	0.0	56.4	0.0	0.0	56.4	0.0	0.0
>180	67.4	63.5	3.1	45.0	43.4	5.4	17.0
<b>Total</b>	<b>1698.2</b>	<b>1734.7</b>	<b>551.5</b>	<b>796.8</b>	<b>547.9</b>	<b>266.2</b>	<b>635.3</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	1.6 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
36-60	1.9 %	2.0 %	1.4 %	1.9 %
61-90	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
91-180	-	2.6 %	2.0 %	2.6 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.6 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.7 %</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**

Sector	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	30	96	5615	4812	28	156	5979	5645	15	190	3361	2856
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2367	3218	0	0	2603	2552	0	0	1456	1256
<b>Otros</b>	96	30	712	664	156	28	1306	1691	190	15	539	1158
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>8694</b>	<b>8694</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>9888</b>	<b>9888</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>5356</b>	<b>5270</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.