

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2020

Fecha de Información: 13 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\$1688.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	314.3	376.1	199.5	183.3	68.6	23.0	108.0
15-35	453.3	455.4	235.0	205.8	51.9	79.0	168.5
36-60	56.6	31.4	1.8	0.0	26.7	53.6	3.0
61-90	57.9	47.2	0.0	0.0	47.2	57.9	0.0
91-180	79.4	30.6	0.0	74.0	30.6	5.4	0.0
>180	25.4	45.3	20.0	0.0	20.3	20.4	5.0
<b>Total</b>	<b>986.9</b>	<b>986.1</b>	<b>456.3</b>	<b>463.1</b>	<b>245.3</b>	<b>239.4</b>	<b>284.5</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	1.8 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	2.0 %	2.2 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.7 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.4 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</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	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	163	6647	6449	17	196	3588	3095	23	142	3536	2827
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	3064	2881	0	0	1516	1385	0	0	910	1306
<b>Otros</b>	163	28	1341	1721	196	17	650	1188	142	23	927	1240
<b>Total</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>11052</b>	<b>11052</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>5754</b>	<b>5668</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5373</b>	<b>5373</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.