

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2020

Fecha de Información: 14 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\$1984.7 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	346.0	408.1	204.3	174.0	42.8	11.0	161.0
15-35	442.0	653.7	392.3	120.7	62.9	122.9	198.5
36-60	132.2	65.9	0.0	36.0	51.9	82.2	14.0
61-90	22.9	8.5	0.0	20.0	8.5	2.9	0.0
91-180	39.8	54.6	10.0	30.0	35.1	0.3	9.5
>180	130.0	123.9	55.0	70.0	8.9	0.0	60.0
<b>Total</b>	<b>1113.0</b>	<b>1314.7</b>	<b>661.6</b>	<b>450.7</b>	<b>210.1</b>	<b>219.3</b>	<b>443.0</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	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.9 %	2.4 %	1.8 %	2.0 %
61-90	-	2.4 %	2.1 %	2.3 %
91-180	-	2.6 %	2.1 %	2.4 %
>180	2.8 %	2.8 %	2.4 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.9 %</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

Sectores	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>	27	169	6914	6705	17	198	3643	3180	24	144	3589	2943
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	3233	3052	0	0	1541	1385	0	0	947	1309
<b>Otros</b>	169	27	1340	1730	198	17	661	1193	144	24	971	1255
<b>Total</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>11487</b>	<b>11487</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>5844</b>	<b>5758</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5507</b>	<b>5507</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.