

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2020

Fecha de Información: 20 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\$686.4 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	138.8	103.9	76.7	118.7	7.3	0.1	20.0
15-35	272.1	278.4	35.4	27.9	3.0	4.2	240.0
36-60	23.7	5.3	4.5	11.0	0.8	12.7	0.0
61-90	5.1	29.2	28.1	1.0	1.1	4.1	0.0
91-180	1.7	13.4	6.7	0.3	6.8	1.5	0.0
>180	48.4	26.4	25.1	48.4	1.3	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>489.8</b>	<b>456.7</b>	<b>176.5</b>	<b>207.1</b>	<b>20.2</b>	<b>22.7</b>	<b>260.0</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	1.7 %	2.1 %	1.3 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	3.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	3.0 %	2.1 %	2.3 %
91-180	-	2.7 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	2.9 %	-	2.9 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>1.6 %</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	20 al 24 de enero				27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	199	4092	3567	24	143	3906	3329	21	111	3239	2776
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1710	1552	0	0	1178	1441	0	0	1205	1401
<b>Otros</b>	199	20	809	1406	143	24	1021	1335	111	21	506	774
<b>Total</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>6611</b>	<b>6525</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>6105</b>	<b>6105</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>4951</b>	<b>4951</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.