

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2020

Fecha de Información: 21 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\$2889.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<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	299.3	787.1	150.0	153.5	508.0	16.7	129.1
15-35	556.4	699.9	337.1	183.8	116.7	126.5	246.2
36-60	150.6	48.8	9.7	0.0	9.1	120.6	30.0
61-90	3.8	14.8	0.0	0.0	14.8	3.8	0.0
91-180	60.3	36.5	0.0	41.0	36.5	19.3	0.0
>180	529.4	134.2	90.0	23.0	17.7	479.9	26.5
<b>Total</b>	<b>1599.9</b>	<b>1721.4</b>	<b>586.8</b>	<b>401.3</b>	<b>702.8</b>	<b>766.8</b>	<b>431.8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.4 %	2.1 %	2.3 %
91-180	-	2.7 %	2.3 %	2.5 %
>180	2.7 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.2 %</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	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
Sector Financiero**	19	192	4273	4209	24	140	4017	3472	23	112	3250	2806
Intragruppo y off-shore***	0	0	1841	1650	0	0	1198	1496	0	0	1232	1401
Otros	192	19	1237	1406	140	24	1098	1344	112	23	509	785
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>7351</b>	<b>7265</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>6312</b>	<b>6312</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>4991</b>	<b>4991</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 intragruppo.