

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2020

Fecha de Información: 30 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\$2918.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	444.5	427.7	105.0	151.5	221.5	191.8	101.2
15-35	824.9	990.4	456.3	293.7	148.7	145.7	385.5
36-60	69.5	34.9	19.9	0.0	15.0	69.5	0.0
61-90	322.5	278.2	150.0	160.0	16.0	50.3	112.2
91-180	32.8	16.4	2.5	0.0	13.9	32.8	0.0
>180	54.2	42.8	20.0	0.0	1.8	33.2	21.0
<b>Total</b>	<b>1748.4</b>	<b>1790.4</b>	<b>753.6</b>	<b>605.2</b>	<b>416.9</b>	<b>523.3</b>	<b>619.9</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	2.0 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.5 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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	27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	171	5132	4636	28	109	3852	3487	37	181	3565	3877
Intragruppo y off-shore***	0	0	1707	1911	0	0	1323	1528	0	0	2017	1378
Otros	171	21	1337	1629	109	28	846	1007	181	37	738	1067
<b>Total</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>8176</b>	<b>8176</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6021</b>	<b>6021</b>	<b>218</b>	<b>218</b>	<b>6321</b>	<b>6321</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.