

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2020

Fecha de Información: 04 de febrero 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\$2423.0 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	226.6	207.0	118.0	162.0	46.0	21.6	43.0
15-35	874.0	766.2	288.0	430.2	119.2	84.8	359.0
36-60	77.7	142.3	30.0	0.0	111.3	76.7	1.0
61-90	94.2	139.3	110.0	10.0	19.3	74.2	10.0
91-180	19.5	26.5	0.0	0.0	26.5	19.5	0.0
>180	179.1	126.6	20.0	120.0	63.6	16.1	43.0
<b>Total</b>	<b>1471.2</b>	<b>1407.8</b>	<b>566.0</b>	<b>722.2</b>	<b>385.8</b>	<b>293.0</b>	<b>456.0</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 %	1.9 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
91-180	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</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	3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	131	4493	4233	38	187	3841	4272	54	135	4470	3646
Intragrupa y off-shore***	0	0	1675	1842	0	0	2155	1414	0	0	1461	1577
Otros	131	22	942	1034	187	38	777	1088	135	54	720	1429
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>7109</b>	<b>7109</b>	<b>225</b>	<b>225</b>	<b>6773</b>	<b>6773</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>6652</b>	<b>6652</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.