

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2020

Fecha de Información: 07 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\$1844.5 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	166.9	356.6	201.5	50.0	87.1	48.9	68.0
15-35	487.4	648.1	316.2	176.0	39.9	19.4	292.0
36-60	62.3	35.5	0.0	15.9	4.5	15.4	31.0
61-90	65.5	127.1	65.0	15.0	27.1	15.5	35.0
91-180	19.2	7.7	0.0	0.0	7.7	19.2	0.0
>180	252.1	127.1	33.0	156.0	9.1	11.1	85.0
<b>Total</b>	<b>1053.4</b>	<b>1302.1</b>	<b>615.7</b>	<b>412.9</b>	<b>175.5</b>	<b>129.5</b>	<b>511.0</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	1.8 %	1.8 %	1.3 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	2.1 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
61-90	2.3 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-	3.0 %	1.8 %	2.2 %
>180	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.5 %
<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

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
<b>Sector Financiero**</b>	21	133	4705	4678	39	189	4409	4824	56	134	4616	4046
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1926	1961	0	0	2363	1675	0	0	1628	1586
<b>Otros</b>	133	21	1056	1050	189	39	1015	1288	134	56	838	1450
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>7688</b>	<b>7688</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>7787</b>	<b>7787</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>7082</b>	<b>7082</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.