

Fecha de Publicación: 08 de enero de 2020

Fecha de Información: 03 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\$1280.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	337.1	336.7	143.0	140.0	26.7	30.1	167.0
15-35	407.6	256.0	121.5	264.4	36.0	44.8	98.5
36-60	2.6	19.7	0.0	0.0	19.7	2.6	0.0
61-90	10.5	48.0	0.0	0.0	38.0	0.5	10.0
91-180	0.4	36.3	0.0	0.0	36.3	0.4	0.0
>180	73.9	87.5	0.0	6.2	27.5	7.7	60.0
<b>Total</b>	<b>832.1</b>	<b>784.3</b>	<b>264.5</b>	<b>410.6</b>	<b>184.3</b>	<b>86.1</b>	<b>335.5</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	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	2.2 %	1.4 %	2.1 %
61-90	1.8 %	2.3 %	1.3 %	2.2 %
91-180	-	2.5 %	1.2 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</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	30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero				13 al 17 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	16	69	2783	2770	30	92	4740	4081	26	153	5473	4954
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1861	1915	0	0	2221	2877	0	0	2282	2270
<b>Otros</b>	69	16	237	189	92	30	475	479	153	26	1148	1680
<b>Total</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>4880</b>	<b>4874</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>7437</b>	<b>7437</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>8903</b>	<b>8903</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.