

**Fecha de Publicación: 14 de enero de 2020**

**Fecha de Información: 10 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\$1837.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	264.3	253.8	115.0	194.0	84.8	16.3	54.0
15-35	454.4	603.9	424.7	286.8	37.7	26.1	141.5
36-60	45.9	46.5	0.0	0.0	46.5	45.9	0.0
61-90	187.8	60.1	30.0	175.0	20.1	2.8	10.0
91-180	1.8	13.8	0.0	0.0	13.8	1.8	0.0
>180	57.8	77.9	45.0	30.0	7.9	2.8	25.0
<b>Total</b>	<b>1011.9</b>	<b>1055.9</b>	<b>614.7</b>	<b>685.8</b>	<b>210.7</b>	<b>95.7</b>	<b>230.5</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.9 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.4 %	1.9 %	2.2 %
61-90	2.2 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	3.1 %	2.1 %	3.0 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.7 %</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**

Sectores	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	98	5682	4902	28	155	6425	6215	17	193	3492	2971
Intragruo y off-shore***	0	0	2418	3235	0	0	2905	2745	0	0	1480	1338
Otros	98	30	716	679	155	28	1344	1714	193	17	592	1169
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>8816</b>	<b>8816</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>10674</b>	<b>10674</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>5564</b>	<b>5478</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 intragruo.