

**Fecha de Publicación: 17 de enero de 2020**

**Fecha de Información: 15 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\$2749.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	500.4	525.1	234.1	188.5	136.0	156.9	155.0
15-35	451.6	595.9	454.9	241.3	77.5	146.8	63.5
36-60	372.9	119.4	10.0	164.0	109.4	208.9	0.0
61-90	137.5	3.9	0.0	117.7	3.9	19.8	0.0
91-180	27.8	86.1	50.0	10.0	21.1	2.8	15.0
>180	84.7	97.4	50.7	48.4	26.7	16.4	20.0
<b>Total</b>	<b>1574.9</b>	<b>1427.7</b>	<b>799.7</b>	<b>769.8</b>	<b>374.5</b>	<b>551.6</b>	<b>253.5</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	
3-14	2.2 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	-	2.1 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.6 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.7 %	1.8 %	2.5 %
>180	2.7 %	3.1 %	2.7 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</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	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	173	7187	7030	17	198	3807	3316	25	145	3677	3020
Intragrupo y off-shore***	0	0	3464	3217	0	0	1545	1409	0	0	956	1309
Otros	173	25	1340	1743	198	17	793	1333	145	25	980	1284
<b>Total</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>11990</b>	<b>11990</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>6144</b>	<b>6058</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5613</b>	<b>5613</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.