

**Fecha de Publicación: 21 de enero de 2020**

**Fecha de Información: 17 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\$1377.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	125.3	200.5	130.0	45.3	5.5	15.0	65.0
15-35	520.9	489.2	155.6	133.5	136.1	189.9	197.5
36-60	46.9	17.5	0.0	0.0	17.5	46.9	0.0
61-90	32.8	48.4	40.0	10.0	8.4	22.8	0.0
91-180	75.8	72.5	10.0	22.0	12.5	3.8	50.0
>180	24.9	35.7	30.0	10.0	5.7	14.9	0.0
<b>Total</b>	<b>826.5</b>	<b>863.7</b>	<b>365.6</b>	<b>220.8</b>	<b>185.7</b>	<b>293.2</b>	<b>312.5</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	2.0 %	1.9 %	-2.4 %	1.1 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.4 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.6 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.7 %	2.6 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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.

<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.

**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
<b>Sector Financiero**</b>	25	173	7224	7097	21	199	4030	3483	24	143	3826	3301
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	3524	3249	0	0	1647	1513	0	0	1153	1362
Otros	173	25	1346	1748	199	21	808	1404	143	24	1018	1335
Total	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>12094</b>	<b>12094</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>6486</b>	<b>6400</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>5997</b>	<b>5997</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.