

**Fecha de Publicación: 28 de enero de 2020**

**Fecha de Información: 24 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\$1821.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	98.3	177.9	93.0	35.0	41.9	20.3	43.0
15-35	633.3	557.7	208.3	258.1	81.4	107.2	268.0
36-60	106.9	117.1	0.0	0.0	117.1	106.9	0.0
61-90	66.0	33.9	0.0	40.0	13.9	6.0	20.0
91-180	14.3	30.6	20.0	0.0	10.6	14.3	0.0
>180	215.9	220.6	100.0	0.0	0.6	95.9	120.0
<b>Total</b>	<b>1134.7</b>	<b>1137.9</b>	<b>421.3</b>	<b>333.1</b>	<b>265.6</b>	<b>350.6</b>	<b>451.0</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	2.2 %	1.1 %	1.5 %	1.4 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.3 %
91-180	-	2.6 %	2.3 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.5 %	2.5 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.1 %</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	20 al 24 de enero				27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	202	4611	4490	28	144	4290	3897	21	110	3341	2971
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1955	1827	0	0	1392	1521	0	0	1258	1421
<b>Otros</b>	202	18	1254	1418	144	28	1307	1569	110	21	601	808
<b>Total</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>7820</b>	<b>7734</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>6988</b>	<b>6988</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>5200</b>	<b>5200</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.