

**Fecha de Publicación: 30 de enero de 2020**

**Fecha de Información: 28 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\$2054.6 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	307.0	277.9	81.3	117.5	19.7	12.5	177.0
15-35	495.9	469.9	256.5	274.6	90.6	98.6	122.8
36-60	283.0	312.6	70.0	15.4	141.1	166.1	101.5
61-90	22.3	10.0	0.1	0.0	9.8	22.3	0.0
91-180	92.6	90.9	20.2	2.5	19.7	39.1	51.0
>180	105.7	69.0	17.0	4.0	22.0	71.7	30.0
<b>Total</b>	<b>1306.6</b>	<b>1230.3</b>	<b>445.0</b>	<b>414.0</b>	<b>303.0</b>	<b>410.3</b>	<b>482.3</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	1.9 %		2.2 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.0 %		2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.2 %		2.3 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-		2.5 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.3 %		2.5 %	2.3 %	2.4 %
>180	2.5 %		2.6 %	2.5 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>		<b>2.2 %</b>	<b>2.0 %</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	27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	169	4755	4267	21	107	3477	3122	28	177	3390	3796
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1521	1705	0	0	1281	1465	0	0	1984	1314
<b>Otros</b>	169	21	1319	1623	107	21	653	825	177	28	717	981
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>7596</b>	<b>7596</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5412</b>	<b>5412</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>6091</b>	<b>6091</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.