

**Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2020**

**Fecha de Información: 06 de febrero 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\$2738.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	363.3	457.6	123.0	63.0	195.6	161.3	139.0
15-35	993.8	741.7	272.0	442.5	97.4	179.0	372.3
36-60	25.7	12.8	0.0	0.0	12.8	25.7	0.0
61-90	57.1	188.3	130.0	0.0	6.3	5.1	52.0
91-180	156.7	184.0	110.0	20.0	13.0	75.7	61.0
>180	119.9	84.9	50.0	90.0	11.9	6.9	23.0
<b>Total</b>	<b>1716.4</b>	<b>1669.3</b>	<b>685.0</b>	<b>615.5</b>	<b>337.0</b>	<b>453.6</b>	<b>647.3</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	1.7 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.7 %		1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-		2.2 %	1.9 %	2.0 %
61-90	2.0 %		2.3 %	2.1 %	2.1 %
91-180	2.2 %		2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.4 %		2.5 %	2.5 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>		<b>1.9 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</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	3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	131	4705	4601	39	185	4254	4699	56	134	4605	3895
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1926	1961	0	0	2229	1625	0	0	1561	1586
<b>Otros</b>	131	20	980	1050	185	39	1085	1244	134	56	762	1446
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>7611</b>	<b>7611</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>7568</b>	<b>7568</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>6927</b>	<b>6927</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.