

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2020

Fecha de Información: 10 de marzo 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\$2632.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	370.2	418.5	214.5	192.7	37.0	10.5	167.0
15-35	687.1	743.6	420.9	330.0	22.9	57.3	299.8
36-60	312.7	198.6	0.0	46.0	48.6	116.7	150.0
61-90	10.5	22.7	17.3	0.0	5.4	10.5	0.0
91-180	191.7	233.8	118.7	40.0	5.1	41.7	110.0
>180	155.0	125.5	10.0	9.5	4.5	34.5	111.0
<b>Total</b>	<b>1727.3</b>	<b>1742.6</b>	<b>781.4</b>	<b>618.2</b>	<b>123.5</b>	<b>271.3</b>	<b>837.8</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	3.2 %	2.9 %	2.5 %	3.0 %
15-35	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.0 %
36-60	3.1 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	3.6 %	2.2 %	2.7 %
91-180	3.4 %	3.7 %	2.8 %	3.3 %
>180	3.5 %	3.4 %	3.1 %	3.4 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.1 %</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

Sector	9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	137	6003	5958	27	141	6528	5818	17	436	3660	3741
Intragrupa y off-shore***	0	0	2722	2541	0	0	2328	2403	0	0	1537	1104
Otros	137	25	1503	1729	141	27	1104	1739	436	17	1060	1413
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>10228</b>	<b>10228</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>9960</b>	<b>9960</b>	<b>453</b>	<b>453</b>	<b>6258</b>	<b>6258</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.