

Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2020

Fecha de Información: 17 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\$2935.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<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	497.2	728.0	357.2	90.9	116.4	151.8	254.5
15-35	766.2	829.6	363.5	253.0	94.6	141.7	371.5
36-60	69.2	39.6	15.0	30.0	24.6	39.2	0.0
61-90	59.6	53.2	0.0	0.0	53.2	59.6	0.0
91-180	226.5	131.4	116.0	85.0	10.4	136.5	5.0
>180	132.5	77.5	0.7	51.0	32.2	36.9	44.6
<b>Total</b>	<b>1751.2</b>	<b>1859.4</b>	<b>852.4</b>	<b>509.9</b>	<b>331.4</b>	<b>565.8</b>	<b>675.6</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	2.3 %	2.2 %	1.4 %	2.0 %
15-35	2.4 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %
36-60	-	3.1 %	2.5 %	2.8 %
61-90	-	3.7 %	3.0 %	3.3 %
91-180	3.3 %	4.5 %	3.4 %	3.5 %
>180	3.5 %	3.9 %	3.5 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.5 %</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	16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	160	8063	7590	18	459	4364	4422	24	99	5182	5808
Intragrupa y off-shore***	0	0	2958	2844	0	0	1822	1335	0	1	3098	2209
Otros	160	51	1480	2068	459	18	1108	1537	99	24	824	1087
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>12501</b>	<b>12501</b>	<b>477</b>	<b>477</b>	<b>7294</b>	<b>7294</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>9104</b>	<b>9104</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.