

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2011.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	477.6	249.4	65.8	391.9	106.4	8.5	77.2
15-35	427.9	609.9	429.0	168.9	19.9	98.0	161.0
36-60	93.9	103.5	42.0	0.0	41.5	73.9	20.0
61-90	115.3	51.6	15.4	5.4	36.3	109.9	0.0
91-180	6.4	53.3	27.0	5.4	26.3	1.1	0.0
>180	22.8	57.9	55.0	20.6	2.9	2.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1144.0</b>	<b>1125.7</b>	<b>634.2</b>	<b>592.1</b>	<b>233.3</b>	<b>293.7</b>	<b>258.2</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.8 %	3.2 %	2.7 %	2.9 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
36-60	2.8 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %
61-90	-	4.9 %	3.0 %	3.5 %
91-180	-	3.5 %	2.3 %	3.4 %
>180	-	3.2 %	3.1 %	3.1 %
<b>Total</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.0 %</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	23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	460	5004	5190	25	99	5644	6134	3	100	4442	4993
Intragruppo y off-shore***	0	0	2061	1596	0	1	3205	2526	0	0	3049	2217
Otros	460	18	1382	1661	99	24	914	1103	100	3	340	619
<b>Total</b>	<b>478</b>	<b>478</b>	<b>8447</b>	<b>8447</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>9763</b>	<b>9763</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>7830</b>	<b>7830</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.