

**Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2020**

**Fecha de Información: 03 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\$3362.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	423.0	397.2	182.4	176.9	73.8	105.1	141.0
15-35	943.7	987.5	617.3	400.7	42.8	215.6	327.5
36-60	229.4	205.1	20.0	0.0	145.1	189.4	40.0
61-90	51.1	29.2	0.0	0.0	29.2	51.1	0.0
91-180	178.9	48.6	0.0	129.0	13.6	14.9	35.0
>180	226.1	257.9	161.0	98.0	24.9	56.1	72.0
<b>Total</b>	<b>2052.2</b>	<b>1925.5</b>	<b>980.7</b>	<b>804.6</b>	<b>329.3</b>	<b>632.2</b>	<b>615.5</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	1.1 %		1.1 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.1 %		1.5 %	1.0 %	1.2 %
36-60	1.8 %		1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-		2.1 %	1.8 %	1.9 %
91-180	2.1 %		2.3 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.7 %		2.8 %	2.6 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>		<b>1.7 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.5 %</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	2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	98	6346	5271	27	116	5032	5068	26	141	5958	5001
Intragrupo y off-shore***	0	0	2155	2868	0	0	2122	1905	0	0	1813	2152
Otros	98	22	1104	1461	116	27	1340	1520	141	26	1009	1628
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>9605</b>	<b>9600</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>8493</b>	<b>8493</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>8781</b>	<b>8781</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.