

**Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2020**

**Fecha de Información: 04 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\$3104.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	412.9	474.4	287.0	212.5	152.4	165.4	35.0
15-35	583.3	1013.1	606.2	183.5	126.9	119.8	280.0
36-60	178.3	35.7	0.0	0.0	35.7	178.3	0.0
61-90	57.4	62.7	0.0	0.0	7.7	2.4	55.0
91-180	217.3	64.7	10.0	175.0	34.7	22.3	20.0
>180	295.9	156.2	98.5	78.5	0.7	160.4	57.0
<b>Total</b>	<b>1745.1</b>	<b>1806.7</b>	<b>1001.7</b>	<b>649.5</b>	<b>358.0</b>	<b>648.6</b>	<b>447.0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.4 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.2 %	1.4 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.9 %	2.3 %	1.7 %	2.0 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.3 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.6 %</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**	19	101	6520	5570	21	116	5401	5388	26	141	6154	5124
Intragruo y off-shore***	0	0	2444	3034	0	0	2275	2092	0	0	1869	2278
Otros	101	19	1114	1469	116	21	1481	1678	141	26	1060	1680
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>10079</b>	<b>10074</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>9157</b>	<b>9157</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>9083</b>	<b>9083</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 intragruo.