

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2020

Fecha de Información: 06 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\$2634.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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         | 278.6               | 248.3         | 190.2                     | 192.0        | 7.4           | 35.9         | 50.7           |
| 15-35        | 738.0               | 1022.3        | 547.3                     | 233.3        | 36.1          | 65.7         | 439.0          |
| 36-60        | 159.7               | 121.6         | 0.0                       | 0.0          | 97.6          | 135.7        | 24.0           |
| 61-90        | 45.6                | 14.6          | 0.0                       | 20.0         | 4.6           | 15.6         | 10.0           |
| 91-180       | 101.1               | 153.1         | 123.0                     | 40.0         | 10.1          | 41.1         | 20.0           |
| >180         | 295.3               | 72.3          | 0.0                       | 159.1        | 0.3           | 64.2         | 72.0           |
| <b>Total</b> | <b>1618.4</b>       | <b>1632.3</b> | <b>860.5</b>              | <b>644.4</b> | <b>156.1</b>  | <b>358.3</b> | <b>615.7</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 %              | 2.1 %                        | 1.6 %        | 2.0 %        |
| 15-35        | 2.3 %              | 2.1 %                        | 2.1 %        | 2.2 %        |
| 36-60        | 2.4 %              | 2.4 %                        | 2.3 %        | 2.4 %        |
| 61-90        | 2.7 %              | 2.8 %                        | 2.4 %        | 2.5 %        |
| 91-180       | 2.8 %              | 3.1 %                        | 2.6 %        | 2.8 %        |
| >180         | 3.1 %              | 3.1 %                        | 2.7 %        | 2.9 %        |
| <b>Total</b> | <b>2.4 %</b>       | <b>2.2 %</b>                 | <b>2.3 %</b> | <b>2.3 %</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           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 22              | 107        | 6557         | 5704         | 24               | 121        | 5740        | 5643        | 26                | 139        | 6286        | 5365        |
| <b>Intragrupo y off-shore***</b> | 0               | 0          | 2562         | 3064         | 0                | 0          | 2464        | 2320        | 0                 | 0          | 2079        | 2335        |
| <b>Otros</b>                     | 107             | 22         | 1129         | 1477         | 121              | 24         | 1478        | 1719        | 139               | 26         | 1065        | 1730        |
| <b>Total</b>                     | <b>129</b>      | <b>129</b> | <b>10249</b> | <b>10244</b> | <b>146</b>       | <b>146</b> | <b>9682</b> | <b>9682</b> | <b>165</b>        | <b>165</b> | <b>9430</b> | <b>9430</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.