

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2020

Fecha de Información: 09 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\$2334.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.<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	151.3	337.0	270.0	96.3	31.4	19.4	35.6
15-35	523.7	548.2	331.7	245.8	80.5	141.9	136.0
36-60	189.4	201.3	123.0	105.0	58.0	64.1	20.3
61-90	18.0	3.6	0.0	0.3	3.6	17.7	0.0
91-180	47.4	99.6	80.5	0.0	17.2	45.4	2.0
>180	259.6	189.3	148.6	142.8	0.7	76.9	40.0
<b>Total</b>	<b>1189.3</b>	<b>1379.0</b>	<b>953.8</b>	<b>590.1</b>	<b>191.4</b>	<b>365.4</b>	<b>233.9</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	2.7 %	3.7 %	2.7 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.4 %	2.8 %	3.2 %
36-60	3.3 %	3.5 %	3.0 %	3.3 %
61-90	-	2.2 %	2.5 %	2.5 %
91-180	3.3 %	3.9 %	2.8 %	3.1 %
>180	3.3 %	3.5 %	2.8 %	3.0 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.2 %</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	9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	126	5859	5825	27	139	6311	5517	17	437	3584	3684
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2606	2402	0	0	2208	2350	0	0	1492	1044
<b>Otros</b>	126	25	1490	1728	139	27	1082	1733	437	17	1059	1407
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>9954</b>	<b>9954</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>9600</b>	<b>9600</b>	<b>454</b>	<b>454</b>	<b>6135</b>	<b>6135</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.