

**Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2020**

**Fecha de Información: 16 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\$2632.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.<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	641.5	802.3	155.0	71.5	96.0	18.7	551.3
15-35	986.7	837.0	245.5	342.6	7.2	59.8	584.3
36-60	68.6	60.3	30.0	10.0	15.3	43.6	15.0
61-90	13.5	28.0	0.5	0.4	21.6	7.1	6.0
91-180	71.8	128.4	75.0	40.0	29.9	8.2	23.6
>180	69.7	120.4	70.0	10.0	35.3	44.5	15.2
<b>Total</b>	<b>1851.8</b>	<b>1976.4</b>	<b>576.0</b>	<b>474.5</b>	<b>205.2</b>	<b>182.0</b>	<b>1195.3</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	2.2 %		3.4 %	1.7 %	2.4 %
15-35	2.5 %		2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.9 %		4.3 %	2.1 %	2.7 %
61-90	3.4 %		3.9 %	3.0 %	3.6 %
91-180	3.3 %		3.7 %	3.5 %	3.6 %
>180	3.7 %		3.7 %	3.2 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>		<b>3.3 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.6 %</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	16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	160	7836	7167	18	458	4125	4183	24	98	5059	5572
Intragrupo y off-shore***	0	0	2753	2823	0	0	1711	1270	0	1	3052	2188
Otros	160	51	1373	1971	458	18	1101	1484	98	24	734	1085
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>11961</b>	<b>11961</b>	<b>476</b>	<b>476</b>	<b>6937</b>	<b>6937</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>8845</b>	<b>8845</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.