

**Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2020**

**Fecha de Información: 19 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\$3293.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.<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	444.3	517.6	104.4	181.4	260.2	109.9	153.0
15-35	815.4	883.7	404.4	85.4	147.9	398.6	331.4
36-60	88.6	252.7	0.0	0.0	216.7	52.6	36.0
61-90	161.2	24.9	0.0	0.0	24.9	161.2	0.0
91-180	385.1	82.5	59.0	20.0	13.5	355.1	10.0
>180	155.4	32.1	0.0	5.0	12.1	130.4	20.0
<b>Total</b>	<b>2050.0</b>	<b>1793.6</b>	<b>567.8</b>	<b>291.8</b>	<b>675.4</b>	<b>1207.8</b>	<b>550.4</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	2.6 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.2 %	2.6 %
36-60	3.0 %	2.9 %	2.1 %	2.8 %
61-90	-	3.8 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
>180	3.8 %	4.1 %	3.4 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>2.8 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.7 %</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**	52	161	8411	7833	18	459	4697	4953	24	99	5486	6001
Intragruo y off-shore***	0	0	3050	3036	0	0	1947	1407	0	1	3188	2414
Otros	161	52	1482	2074	459	18	1370	1655	99	24	838	1096
<b>Total</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>12943</b>	<b>12943</b>	<b>477</b>	<b>477</b>	<b>8014</b>	<b>8014</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>9511</b>	<b>9511</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.