

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2020

Fecha de Información: 26 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\$3658.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	895.1	639.3	97.1	713.6	470.6	109.9	71.6
15-35	638.7	805.6	615.1	385.0	83.3	146.5	107.2
36-60	377.9	19.9	6.8	0.0	13.1	377.9	0.0
61-90	6.6	188.2	164.5	3.5	23.7	3.1	0.0
91-180	1.1	183.3	120.0	0.0	63.3	1.1	0.0
>180	56.1	55.7	0.0	0.0	25.7	26.1	30.0
<b>Total</b>	<b>1975.5</b>	<b>1892.0</b>	<b>1003.5</b>	<b>1102.1</b>	<b>679.7</b>	<b>664.6</b>	<b>208.8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.0 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
15-35	3.2 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
36-60	-	3.2 %	2.5 %	2.6 %
61-90	-	3.2 %	2.2 %	3.2 %
91-180	-	3.0 %	2.0 %	3.0 %
>180	2.9 %	3.3 %	3.3 %	3.1 %
<b>Total</b>	<b>3.1 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>2.9 %</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	23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	460	5233	5248	25	100	6178	6799	4	100	4912	5188
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2091	1805	0	1	3282	2954	0	0	3097	2567
<b>Otros</b>	460	19	1390	1662	100	24	1436	1142	100	4	455	709
<b>Total</b>	<b>480</b>	<b>480</b>	<b>8715</b>	<b>8715</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>10896</b>	<b>10896</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>8464</b>	<b>8464</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 intragruppo.