

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2020

Fecha de Información: 01 de abril 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\$2706.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	629.7	627.5	184.7	410.9	226.5	2.5	216.2
15-35	765.3	901.8	626.7	56.7	8.6	442.1	266.5
36-60	106.0	22.1	0.0	0.0	22.1	106.0	0.0
61-90	91.0	21.3	12.4	0.0	8.9	91.0	0.0
91-180	6.1	13.5	10.0	0.0	3.5	6.1	0.0
>180	3.6	1.7	0.0	0.0	1.7	3.6	0.0
<b>Total</b>	<b>1601.7</b>	<b>1587.8</b>	<b>833.8</b>	<b>467.6</b>	<b>271.3</b>	<b>651.3</b>	<b>482.7</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	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.4 %	1.8 %	2.1 %
36-60	-	2.9 %	2.3 %	2.4 %
61-90	-	3.1 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	3.2 %	2.1 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	103	7432	7463	5	101	5178	5811	63	119	5517	5473
Intragrupo y off-shore***	0	1	3576	3846	0	0	3179	2657	0	0	2763	1848
Otros	103	30	1448	1147	101	5	822	711	119	63	971	1919
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>12456</b>	<b>12456</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>9179</b>	<b>9179</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>9250</b>	<b>9241</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.