

**Fecha de Publicación: 22 de abril de 2020**

**Fecha de Información: 20 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\$1909.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	274.6	264.6	180.0	221.0	53.1	22.1	31.5
15-35	754.8	730.4	513.5	47.5	7.0	497.4	209.9
36-60	8.0	12.9	0.0	0.0	11.9	7.0	1.0
61-90	4.2	3.9	0.0	0.0	3.9	4.2	0.0
91-180	22.0	35.7	0.0	0.0	19.7	6.0	16.0
>180	25.3	31.1	20.0	25.0	11.1	0.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1089.0</b>	<b>1078.6</b>	<b>713.5</b>	<b>293.5</b>	<b>106.7</b>	<b>537.1</b>	<b>258.4</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.2 %	3.5 %	2.6 %	2.9 %
15-35	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
36-60	3.1 %	3.6 %	2.7 %	3.3 %
61-90	-	3.5 %	2.7 %	3.1 %
91-180	2.9 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	-	2.9 %	2.1 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.1 %</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**

Sector	20 al 24 de abril				27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	105	4820	5363	28	93	4269	4797	20	98	4097	4004
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2383	1226	0	0	2376	918	0	0	2270	1307
<b>Otros</b>	105	35	1305	1920	93	28	762	1692	97	20	599	1656
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>8509</b>	<b>8509</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>7407</b>	<b>7407</b>	<b>117</b>	<b>118</b>	<b>6967</b>	<b>6967</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.