

**Fecha de Publicación: 24 de abril de 2020**

**Fecha de Información: 22 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\$2354.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.<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	571.2	198.7	48.6	375.6	13.6	59.1	136.5
15-35	445.7	814.6	557.7	107.8	42.2	123.2	214.7
36-60	53.5	75.0	35.0	0.0	20.0	33.5	20.0
61-90	31.7	74.7	0.0	0.0	74.7	31.7	0.0
91-180	32.4	258.8	190.0	0.0	68.8	32.4	0.0
>180	119.7	59.9	0.0	1.4	49.9	108.3	10.0
<b>Total</b>	<b>1254.2</b>	<b>1481.7</b>	<b>831.3</b>	<b>484.8</b>	<b>269.2</b>	<b>388.2</b>	<b>381.2</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	2.6 %		2.9 %	2.7 %	2.7 %
15-35	3.2 %		3.3 %	3.0 %	3.2 %
36-60	3.0 %		3.5 %	2.7 %	3.2 %
61-90	-		3.2 %	2.7 %	3.0 %
91-180	-		3.3 %	2.8 %	3.2 %
>180	2.7 %		2.7 %	2.7 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>3.0 %</b>		<b>3.2 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.0 %</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	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
Sector Financiero**	37	114	5372	5520	29	90	4469	5090	20	96	4219	4143
Intragrupo y off-shore***	0	0	2417	1661	0	0	2514	958	0	0	2301	1319
Otros	114	37	1311	1918	90	29	825	1759	96	20	601	1659
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>9100</b>	<b>9100</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>7807</b>	<b>7807</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>7121</b>	<b>7121</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.