

**Fecha de Publicación: 28 de abril de 2020**

**Fecha de Información: 24 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\$2067.7 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         | 345.9               | 232.4         | 137.5                     | 166.5        | 17.9          | 102.4        | 77.0           |
| 15-35        | 565.9               | 850.3         | 499.4                     | 86.5         | 8.9           | 137.4        | 342.0          |
| 36-60        | 5.1                 | 1.9           | 0.0                       | 0.0          | 1.9           | 5.1          | 0.0            |
| 61-90        | 160.1               | 113.2         | 0.0                       | 20.0         | 3.2           | 30.1         | 110.0          |
| 91-180       | 155.5               | 71.6          | 10.0                      | 120.0        | 41.6          | 15.5         | 20.0           |
| >180         | 102.5               | 42.2          | 10.0                      | 40.0         | 2.2           | 32.5         | 30.0           |
| <b>Total</b> | <b>1335.1</b>       | <b>1311.6</b> | <b>656.9</b>              | <b>433.0</b> | <b>75.7</b>   | <b>323.1</b> | <b>579.0</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       |              |
| 3-14         | 3.2 %              | 3.2 %                        | 3.7 %        | 3.5 %        |
| 15-35        | 3.2 %              | 3.2 %                        | 3.0 %        | 3.2 %        |
| 36-60        | -                  | 3.0 %                        | 2.5 %        | 2.6 %        |
| 61-90        | 3.0 %              | 3.2 %                        | 2.6 %        | 2.9 %        |
| 91-180       | 2.9 %              | 2.9 %                        | 2.9 %        | 2.9 %        |
| >180         | 2.7 %              | 2.7 %                        | 2.6 %        | 2.7 %        |
| <b>Total</b> | <b>3.1 %</b>       | <b>3.2 %</b>                 | <b>3.1 %</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**

| 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                | 112        | 5595        | 5615        | 30                      | 89         | 5184        | 5369        | 21             | 96         | 4481        | 4462        |
| Intragrupo y off-shore*** | 0                 | 0          | 2468        | 1854        | 0                       | 0          | 2641        | 1497        | 0              | 0          | 2498        | 1320        |
| Otros                     | 112               | 37         | 1322        | 1916        | 89                      | 30         | 836         | 1795        | 95             | 21         | 638         | 1835        |
| <b>Total</b>              | <b>148</b>        | <b>148</b> | <b>9385</b> | <b>9385</b> | <b>119</b>              | <b>119</b> | <b>8661</b> | <b>8661</b> | <b>117</b>     | <b>117</b> | <b>7617</b> | <b>7617</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.