

**Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2020**

**Fecha de Información: 30 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\$1701.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	320.9	249.5	124.0	174.1	53.2	74.6	72.3
15-35	583.9	543.8	337.8	115.9	56.4	318.5	149.5
36-60	27.1	7.0	0.0	0.0	7.0	27.1	0.0
61-90	18.7	54.1	10.0	0.0	34.1	8.7	10.0
91-180	61.6	34.2	0.0	4.5	18.1	41.0	16.1
>180	34.3	34.0	5.0	10.0	9.0	4.3	20.0
<b>Total</b>	<b>1046.5</b>	<b>922.4</b>	<b>476.8</b>	<b>304.4</b>	<b>177.7</b>	<b>474.2</b>	<b>267.9</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	3.4 %	3.6 %	3.1 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.7 %	3.1 %	3.4 %
36-60	-	3.8 %	3.0 %	3.1 %
61-90	3.2 %	3.3 %	2.8 %	3.2 %
91-180	2.9 %	3.3 %	2.8 %	2.9 %
>180	2.8 %	3.3 %	2.5 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>3.3 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	27 de abr. al 1 de mayo				4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	93	6112	5940	25	99	5239	4967	24	94	4552	5064
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2840	2354	0	0	2748	1739	0	0	2909	1064
<b>Otros</b>	93	21	1134	1791	99	25	708	1989	94	24	680	2012
<b>Total</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>10086</b>	<b>10086</b>	<b>124</b>	<b>125</b>	<b>8695</b>	<b>8695</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>8140</b>	<b>8140</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.