

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2020

Fecha de Información: 08 de mayo 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\$1447.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	385.3	371.7	131.5	82.5	52.7	115.3	187.5
15-35	509.4	336.7	116.5	155.5	87.9	221.6	132.3
36-60	22.5	16.6	0.0	0.0	16.6	22.5	0.0
61-90	5.7	21.0	0.0	0.0	21.0	5.7	0.0
91-180	3.8	28.6	0.0	0.0	28.6	3.8	0.0
>180	29.0	42.2	10.0	0.0	27.2	24.0	5.0
<b>Total</b>	<b>955.8</b>	<b>816.8</b>	<b>258.0</b>	<b>238.0</b>	<b>234.0</b>	<b>393.0</b>	<b>324.8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.3 %	3.7 %	3.3 %	3.4 %
15-35	3.4 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.6 %
61-90	-	3.7 %	2.8 %	3.5 %
91-180	-	3.4 %	2.4 %	3.3 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.6 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.4 %</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	4 al 8 de mayo				11 al 15 de mayo				18 al 22 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	113	5926	5308	23	98	6033	6134	45	351	5166	5601
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2890	2197	0	0	3285	1838	0	0	3155	1190
<b>Otros</b>	112	39	681	1991	98	23	1010	2356	351	45	865	2395
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9497</b>	<b>9497</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>10328</b>	<b>10328</b>	<b>396</b>	<b>396</b>	<b>9186</b>	<b>9186</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 intragruppo.