

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2020

Fecha de Información: 18 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\$1556.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	355.2	185.5	39.2	218.7	39.4	29.6	106.9
15-35	646.2	533.2	239.5	131.5	29.7	250.7	264.0
36-60	22.6	65.5	10.0	0.0	35.5	2.6	20.0
61-90	0.8	15.9	0.0	0.0	15.9	0.8	0.0
91-180	34.6	43.7	0.0	25.0	43.7	9.6	0.0
>180	24.5	19.3	0.0	21.2	19.3	3.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1084.0</b>	<b>863.2</b>	<b>288.7</b>	<b>396.4</b>	<b>183.6</b>	<b>296.7</b>	<b>390.9</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	3.3 %	4.1 %	2.7 %	3.1 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	3.4 %	3.8 %	2.9 %	3.6 %
61-90	-	3.7 %	2.6 %	3.6 %
91-180	-	3.1 %	3.1 %	3.1 %
>180	-	2.9 %	2.5 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.1 %</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	18 al 22 de mayo				25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	97	361	6218	6036	21	114	2674	3511	13	107	4495	4195
Intragrupo y off-shore***	0	0	3305	1842	0	0	2076	563	0	0	2478	1561
Otros	361	97	922	2568	114	21	624	1300	107	13	380	1597
<b>Total</b>	<b>459</b>	<b>459</b>	<b>10446</b>	<b>10446</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>5374</b>	<b>5374</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>7353</b>	<b>7353</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.