

Fecha de Publicación: 2 de junio de 2020

Fecha de Información: 29 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\$1833.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.<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	450.4	364.5	110.5	203.5	19.5	12.4	234.5
15-35	569.6	438.7	202.3	174.0	96.9	256.1	139.5
36-60	21.9	77.0	0.0	20.0	77.0	1.9	0.0
61-90	12.3	88.5	0.0	0.0	78.5	2.3	10.0
91-180	54.5	56.3	0.0	8.7	35.3	24.8	21.0
>180	54.2	64.5	40.0	20.0	11.0	20.7	13.5
<b>Total</b>	<b>1162.8</b>	<b>1089.4</b>	<b>352.8</b>	<b>426.2</b>	<b>318.1</b>	<b>318.1</b>	<b>418.5</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 %	3.5 %	2.5 %	3.1 %
15-35	3.4 %	3.6 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.5 %	3.3 %	3.5 %
61-90	3.2 %	3.3 %	2.4 %	3.3 %
91-180	3.0 %	3.0 %	2.9 %	3.0 %
>180	2.8 %	2.8 %	2.3 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.2 %</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	25 al 29 de mayo				1 al 5 de junio				8 al 12 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	101	4130	3937	16	113	5444	5183	51	105	5182	5508
Intragrupo y off-shore***	0	0	2129	1661	0	0	2891	1897	0	0	3283	1702
Otros	101	31	659	1321	113	16	510	1765	105	51	555	1810
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>6919</b>	<b>6919</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>8844</b>	<b>8844</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>9021</b>	<b>9021</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.