**Fecha de Publicación: 15 de abril de 2020**

**Fecha de Información: 13 de abril de 2020** [1]

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$2154.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.[2]

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

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 399.5 | 518.9 | 337.2 | 219.7 | 45.2 | 43.3 | 136.5 |
| 15-35 | 535.1 | 605.3 | 441.3 | 132.2 | 26.1 | 264.9 | 138.0 |
| 36-60 | 23.9 | 21.2 | 0.0 | 20.0 | 21.2 | 3.9 | 0.0 |
| 61-90 | 3.4 | 51.9 | 0.0 | 0.0 | 51.9 | 3.4 | 0.0 |
| 91-180 | 57.1 | 94.3 | 20.0 | 0.0 | 19.3 | 2.1 | 55.0 |
| >180 | 63.2 | 118.7 | 100.0 | 50.0 | 9.7 | 4.2 | 9.0 |
| **Total** | **1082.2** | **1410.4** | **898.5** | **421.9** | **173.4** | **321.9** | **338.5** |

* 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 | 2.3 % | 2.2 % | 1.8 % | 2.1 % |
| 15-35 | 2.3 % | 2.3 % | 2.1 % | 2.3 % |
| 36-60 | - | 3.8 % | 1.6 % | 3.4 % |
| 61-90 | - | 3.0 % | 2.0 % | 3.0 % |
| 91-180 | 2.6 % | 2.9 % | 2.1 % | 2.7 % |
| >180 | 2.7 % | 3.0 % | 2.2 % | 2.8 % |
| **Total** | 2.4 % | 2.5 % | 2.0 % | 2.3 % |

*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 | 13 al 17 de abril | | | | 20 al 24 de abril | | | | 27 de abr. al 1 de mayo | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| **Sector Financiero**** | 67 | 142 | 6366 | 6621 | 33 | 93 | 4073 | 4261 | 23 | 92 | 4073 | 4519 |
| **Intragrupo y off-shore***** | 0 | 0 | 3493 | 2262 | 0 | 0 | 1573 | 869 | 0 | 0 | 2294 | 864 |
| **Otros** | 142 | 67 | 1016 | 1983 | 93 | 33 | 1224 | 1739 | 92 | 23 | 625 | 1609 |
| **Total** | **209** | **209** | **10876** | **10866** | **126** | **126** | **6870** | **6870** | **115** | **115** | **6992** | **6992** |

* 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.

[1] Datos provisionales.

[2] 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.