

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2020

Fecha de Información: 18 de junio 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\$2112.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	461.3	297.9	132.0	267.8	17.7	45.3	148.2
15-35	638.5	746.3	556.7	120.4	27.5	356.0	162.2
36-60	16.9	8.6	0.0	5.0	8.6	11.9	0.0
61-90	0.8	49.7	0.0	0.0	49.7	0.8	0.0
91-180	81.8	63.5	7.5	0.0	46.5	72.3	9.5
>180	48.0	66.8	10.0	0.0	8.8	0.0	48.0
<b>Total</b>	<b>1247.3</b>	<b>1232.8</b>	<b>706.2</b>	<b>393.2</b>	<b>158.8</b>	<b>486.3</b>	<b>367.9</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	3.6 %	3.4 %	3.2 %	3.4 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.6 %	3.6 %
36-60	-	3.5 %	3.2 %	3.3 %
61-90	-	3.3 %	2.9 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.7 %	2.9 %	1.9 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.5 %</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**

Sector	15 al 19 de junio				22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	38	163	6307	6086	29	352	5153	4728	19	86	2621	2739
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	2	0	3193	1817	0	0	2453	875	0	0	1409	963
<b>Otros</b>	161	38	734	2331	352	29	657	2661	86	19	273	601
<b>Total</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>10234</b>	<b>10234</b>	<b>381</b>	<b>381</b>	<b>8264</b>	<b>8264</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>4303</b>	<b>4303</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 intragrupo.