

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2353.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	594.1	332.8	90.0	434.9	100.3	16.7	142.5
15-35	574.6	769.4	582.1	133.0	11.6	265.8	175.8
36-60	98.1	15.5	0.6	0.0	15.0	98.1	0.0
61-90	29.1	27.5	10.0	10.0	5.5	7.1	12.0
91-180	97.1	80.3	55.0	15.0	15.3	72.1	10.0
>180	39.6	52.9	25.0	12.0	10.4	10.1	17.5
<b>Total</b>	<b>1432.6</b>	<b>1278.5</b>	<b>762.6</b>	<b>604.9</b>	<b>158.1</b>	<b>469.9</b>	<b>357.8</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	3.5 %	3.6 %	3.6 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-	3.8 %	3.3 %	3.4 %
61-90	3.3 %	3.6 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.0 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.9 %	2.9 %	2.9 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.5 %</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	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	193	6328	5628	25	79	2716	2924	14	318	3675	3736
Intragruppo y off-shore***	0	0	2595	1756	0	0	1509	987	0	0	2234	1034
Otros	193	35	1128	2667	79	25	299	611	318	14	349	1488
<b>Total</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>10051</b>	<b>10051</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4523</b>	<b>4523</b>	<b>332</b>	<b>332</b>	<b>6258</b>	<b>6258</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.