

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2020

Fecha de Información: 06 de julio 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\$1653.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	248.7	275.8	66.0	57.5	60.1	41.5	149.7
15-35	577.4	365.5	198.0	134.5	20.9	296.3	146.6
36-60	42.0	35.7	15.0	0.0	10.7	32.0	10.0
61-90	38.4	13.1	5.8	14.0	7.3	24.4	0.0
91-180	162.2	180.9	130.0	10.0	40.9	142.2	10.0
>180	23.4	6.8	0.0	20.0	6.8	3.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1092.1</b>	<b>877.8</b>	<b>414.8</b>	<b>236.0</b>	<b>146.7</b>	<b>539.8</b>	<b>316.3</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	3.5 %	4.2 %	3.1 %	3.7 %
15-35	3.6 %	3.9 %	3.3 %	3.5 %
36-60	3.4 %	3.8 %	2.7 %	3.0 %
61-90	-	3.8 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %
>180	-	3.6 %	2.6 %	3.2 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>3.2 %</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

Sector	6 al 10 de julio				13 al 17 de julio				20 al 24 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	115	120	4608	4613	35	129	3880	3862	56	116	3596	3674
Intragrupa y off-shore***	0	0	2596	1430	0	0	2096	937	0	0	2413	906
Otros	120	115	406	1566	129	35	652	1829	116	56	307	1736
<b>Total</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>7610</b>	<b>7610</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>6628</b>	<b>6628</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>6317</b>	<b>6317</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.