

Fecha de Publicación: 9 de julio de 2020

Fecha de Información: 07 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\$1629.1 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	410.8	386.5	235.3	257.9	7.6	9.2	143.7
15-35	302.0	480.9	316.2	115.8	19.0	40.6	145.7
36-60	35.4	58.1	28.0	10.0	15.1	10.4	15.0
61-90	10.4	15.2	10.2	0.0	5.0	10.4	0.0
91-180	68.1	152.2	80.0	0.0	14.2	10.1	58.0
>180	60.8	33.6	5.0	36.2	6.1	2.1	22.5
<b>Total</b>	<b>887.5</b>	<b>1126.5</b>	<b>674.6</b>	<b>419.8</b>	<b>66.9</b>	<b>82.8</b>	<b>384.9</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	3.7 %	2.6 %	3.8 %	3.5 %
15-35	3.6 %	3.6 %	2.9 %	3.5 %
36-60	3.3 %	3.8 %	3.4 %	3.5 %
61-90	-	3.8 %	3.1 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
>180	3.0 %	2.9 %	2.7 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.4 %</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**	118	125	4914	4803	35	131	3963	4057	52	115	3625	3690
Intragrupa y off-shore***	0	0	2691	1642	0	0	2236	961	0	0	2430	928
Otros	125	118	408	1567	131	35	656	1837	115	52	306	1744
<b>Total</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>8013</b>	<b>8013</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>6855</b>	<b>6855</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>6361</b>	<b>6361</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.