

**Fecha de Publicación: 10 de junio de 2020**

**Fecha de Información: 08 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\$1928.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	174.2	436.4	287.1	30.5	25.3	19.7	124.0
15-35	932.5	592.4	204.9	208.0	14.3	351.3	373.2
36-60	61.1	53.8	0.0	9.8	3.8	1.4	50.0
61-90	17.4	16.7	0.0	0.0	14.7	15.4	2.0
91-180	58.9	109.8	0.0	0.0	99.8	48.9	10.0
>180	27.1	32.4	1.2	0.0	6.2	2.1	25.0
<b>Total</b>	<b>1271.3</b>	<b>1241.5</b>	<b>493.2</b>	<b>248.3</b>	<b>164.1</b>	<b>438.8</b>	<b>584.2</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	
3-14	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.5 %	2.9 %	3.2 %
36-60	3.3 %	7.8 %	3.1 %	3.5 %
61-90	3.2 %	4.5 %	3.1 %	3.8 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %
>180	2.9 %	2.9 %	2.5 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>3.2 %</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**

Sectores	8 al 12 de junio				15 al 19 de junio				22 al 26 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	75	123	6258	6951	33	115	5054	4990	24	353	4586	3771
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	3682	1951	2	0	2635	1119	0	0	1903	804
<b>Otros</b>	123	75	916	1955	113	33	731	2310	353	24	588	2502
<b>Total</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>10856</b>	<b>10856</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>8420</b>	<b>8420</b>	<b>377</b>	<b>377</b>	<b>7077</b>	<b>7077</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.