

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2020

Fecha de Información: 09 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\$2871.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	290.5	815.1	200.9	104.5	444.5	16.3	169.7
15-35	514.0	643.0	402.8	173.8	23.5	123.6	216.7
36-60	469.9	39.5	0.0	0.0	39.5	469.9	0.0
61-90	140.6	64.0	1.8	0.0	22.2	100.6	40.0
91-180	106.7	162.3	120.0	25.0	32.3	71.7	10.0
>180	52.8	12.9	0.0	0.0	9.4	49.3	3.5
<b>Total</b>	<b>1574.5</b>	<b>1736.8</b>	<b>725.5</b>	<b>303.3</b>	<b>571.5</b>	<b>831.3</b>	<b>439.9</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.6 %	3.5 %	3.5 %	3.5 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	3.7 %	3.3 %	3.3 %
61-90	3.4 %	2.7 %	3.0 %	3.1 %
91-180	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.9 %	3.5 %	2.8 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.3 %</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**

Sectores	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
<b>Sector Financiero**</b>	119	130	5405	5035	35	135	4268	4998	52	116	3707	3755
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2809	2015	0	0	2596	1137	0	0	2430	941
<b>Otros</b>	130	119	405	1570	135	35	1127	1856	116	52	311	1752
<b>Total</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>8620</b>	<b>8620</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>7991</b>	<b>7991</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6449</b>	<b>6449</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.