

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2020

Fecha de Información: 13 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\$2441.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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	596.1	274.1	156.3	476.3	24.7	26.7	93.1
15-35	699.9	571.9	442.8	377.6	19.1	212.3	110.0
36-60	27.3	223.9	200.0	0.0	3.9	7.3	20.0
61-90	20.2	60.7	36.8	0.0	3.9	0.2	20.0
91-180	2.1	155.9	108.5	0.0	47.5	2.1	0.0
>180	38.2	29.3	0.0	13.2	14.3	10.0	15.0
<b>Total</b>	<b>1383.9</b>	<b>1315.9</b>	<b>944.3</b>	<b>867.1</b>	<b>113.5</b>	<b>258.6</b>	<b>258.1</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	4.1 %	3.2 %	3.2 %	3.4 %
15-35	4.2 %	4.2 %	3.7 %	4.0 %
36-60	3.8 %	4.3 %	3.4 %	3.7 %
61-90	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.6 %
91-180	-	3.5 %	2.9 %	3.5 %
>180	3.1 %	3.0 %	3.0 %	3.1 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.7 %</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	13 al 17 de julio				20 al 24 de julio				27 al 31 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	42	143	5247	5464	55	120	3733	3841	22	351	2968	3396
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2733	1825	0	0	2504	953	0	0	1814	882
<b>Otros</b>	143	42	1202	1893	120	55	316	1759	351	22	556	1060
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>9182</b>	<b>9182</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>6554</b>	<b>6554</b>	<b>374</b>	<b>374</b>	<b>5338</b>	<b>5338</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.