

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2020

Fecha de Información: 14 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\$2716.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.<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	468.5	598.6	350.0	227.7	78.6	70.8	170.0
15-35	649.5	874.2	559.8	287.1	15.3	63.4	299.0
36-60	4.3	14.3	0.0	0.0	14.3	4.3	0.0
61-90	273.1	43.3	35.0	30.0	8.3	243.1	0.0
91-180	28.4	200.3	132.2	12.9	58.1	5.5	10.0
>180	27.6	23.6	10.3	6.8	3.3	10.8	10.0
<b>Total</b>	<b>1451.4</b>	<b>1754.3</b>	<b>1087.3</b>	<b>564.5</b>	<b>178.0</b>	<b>397.9</b>	<b>489.0</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	4.2 %	4.3 %	3.9 %	4.1 %
15-35	4.2 %	4.3 %	4.1 %	4.2 %
36-60	-	4.4 %	3.7 %	4.3 %
61-90	-	4.0 %	3.3 %	3.3 %
91-180	3.5 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %
>180	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
<b>Total</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>4.0 %</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>	33	155	5558	5583	55	120	3826	4201	22	353	3105	3551
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2795	2025	0	0	2718	964	0	0	1912	957
<b>Otros</b>	155	33	1202	1948	120	55	391	1768	353	22	557	1066
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>9555</b>	<b>9555</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>6934</b>	<b>6934</b>	<b>375</b>	<b>375</b>	<b>5575</b>	<b>5575</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 intragrupo.