

**Fecha de Publicación: 22 de julio de 2020**

**Fecha de Información: 17 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\$2411.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	422.8	807.6	223.6	230.5	403.4	11.7	180.6
15-35	290.7	402.2	260.1	122.0	5.0	31.4	137.2
36-60	393.3	30.5	25.0	0.0	5.5	393.3	0.0
61-90	60.8	56.8	30.0	20.0	1.8	15.8	25.0
91-180	81.0	82.3	79.6	2.4	2.7	78.6	0.0
>180	75.7	53.7	40.0	60.0	10.2	12.2	3.5
<b>Total</b>	<b>1324.3</b>	<b>1433.0</b>	<b>658.2</b>	<b>434.9</b>	<b>428.5</b>	<b>543.1</b>	<b>346.3</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	3.6 %		3.7 %	2.1 %	3.2 %
15-35	3.5 %		3.5 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-		3.4 %	3.4 %	3.4 %
61-90	3.4 %		3.3 %	3.1 %	3.3 %
91-180	-		3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.9 %		3.0 %	2.7 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.5 %</b>		<b>3.6 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.3 %</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
Sector Financiero**	38	155	6068	5704	61	125	4412	4989	22	349	3315	3945
Intragrupo y off-shore***	0	0	2847	2469	0	0	2925	1347	0	0	2139	1020
Otros	155	38	1212	1946	125	61	782	1783	349	22	599	1088
<b>Total</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>10127</b>	<b>10119</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>8119</b>	<b>8119</b>	<b>371</b>	<b>371</b>	<b>6054</b>	<b>6054</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.