

**Fecha de Publicación: 29 de julio de 2020**

**Fecha de Información: 27 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\$1848.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	226.1	253.6	106.1	107.2	40.5	11.9	107.0
15-35	720.2	371.5	182.8	430.8	103.2	204.0	85.5
36-60	15.4	22.2	13.7	6.2	3.5	4.2	5.0
61-90	70.3	6.7	0.1	0.0	6.6	70.3	0.0
91-180	25.5	242.8	220.0	8.6	17.8	11.9	5.0
>180	7.4	91.7	87.3	0.0	1.4	4.4	3.0
<b>Total</b>	<b>1064.9</b>	<b>988.6</b>	<b>610.0</b>	<b>552.8</b>	<b>173.1</b>	<b>306.7</b>	<b>205.5</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.3 %	3.6 %	3.6 %	3.5 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	3.2 %	3.8 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.6 %	3.2 %	3.2 %
91-180	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.0 %
>180	2.7 %	3.4 %	2.6 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.5 %</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	27 al 31 de julio				3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	360	4091	4952	17	109	3476	3899	24	149	4231	5483
Intragruo y off-shore***	0	0	2647	1341	0	0	2435	1022	0	0	3185	1543
Otros	360	34	720	1164	109	17	265	1255	149	24	1018	1359
<b>Total</b>	<b>394</b>	<b>394</b>	<b>7457</b>	<b>7457</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6176</b>	<b>6176</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>8434</b>	<b>8384</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 intragruo.