

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2020

Fecha de Información: 06 de agosto 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\$2402.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	625.2	426.0	202.6	403.8	27.1	25.1	196.4
15-35	580.1	917.9	581.0	172.5	25.0	95.7	311.9
36-60	52.3	19.3	10.6	0.0	8.7	52.3	0.0
61-90	38.3	99.3	60.5	0.0	6.9	6.3	32.0
91-180	37.7	12.8	0.0	10.0	12.8	27.7	0.0
>180	105.2	31.0	10.0	90.0	18.5	12.7	2.5
<b>Total</b>	<b>1438.8</b>	<b>1506.4</b>	<b>864.7</b>	<b>676.3</b>	<b>99.0</b>	<b>219.7</b>	<b>542.8</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	2.9 %	1.4 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.9 %	2.8 %	2.5 %	2.8 %
36-60	-	3.0 %	2.6 %	2.7 %
61-90	2.9 %	3.3 %	1.2 %	2.7 %
91-180	-	2.9 %	2.1 %	2.3 %
>180	2.6 %	2.8 %	1.7 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	3 al 7 de agosto				10 al 14 de agosto				17 al 21 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	30	138	5235	5196	33	383	5962	6889	34	110	3509	3473
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	10	0	2835	2027	0	0	3733	2244	0	0	2175	1251
<b>Otros</b>	128	30	641	1491	383	33	1096	1608	110	34	352	1310
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>8711</b>	<b>8715</b>	<b>417</b>	<b>417</b>	<b>10791</b>	<b>10741</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>6036</b>	<b>6034</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.