

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 16 de septiembre 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\$1766.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	330.8	256.5	60.4	187.9	79.2	26.0	116.9
15-35	614.0	651.6	398.5	114.1	27.8	274.6	225.4
36-60	60.2	20.1	0.0	0.0	20.1	60.2	0.0
61-90	13.1	19.4	0.0	0.0	19.4	13.1	0.0
91-180	5.5	41.2	0.0	0.0	40.2	4.5	1.0
>180	81.0	46.1	0.0	0.0	16.1	51.0	30.0
<b>Total</b>	<b>1104.5</b>	<b>1034.9</b>	<b>458.9</b>	<b>302.0</b>	<b>202.8</b>	<b>429.3</b>	<b>373.3</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	1.6 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.7 %	2.3 %	2.4 %
61-90	-	2.6 %	2.1 %	2.4 %
91-180	2.2 %	2.4 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.3 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</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**

Sector	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	134	5569	5835	39	108	4105	4765	27	87	3949	4521
Intragruppo y off-shore***	0	0	3537	2941	0	0	2721	1121	0	0	2464	876
Otros	134	42	861	1191	108	39	509	1449	87	27	791	1806
<b>Total</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>9966</b>	<b>9966</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7335</b>	<b>7335</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>7203</b>	<b>7203</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 intragruppo.