

**Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2020**

**Fecha de Información: 17 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\$1952.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	367.8	441.0	189.8	187.3	93.2	22.5	158.0
15-35	553.6	409.0	226.0	46.2	52.2	376.6	130.8
36-60	75.4	2.0	0.0	0.0	2.0	75.4	0.0
61-90	214.9	231.6	53.0	0.0	53.6	89.9	125.0
91-180	32.9	10.1	0.0	30.0	10.1	2.9	0.0
>180	21.1	6.6	0.0	0.0	6.6	21.1	0.0
<b>Total</b>	<b>1265.7</b>	<b>1100.3</b>	<b>468.8</b>	<b>263.5</b>	<b>217.6</b>	<b>588.4</b>	<b>413.8</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	2.4 %	2.2 %	1.4 %	2.0 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	4.0 %	2.3 %	2.4 %
61-90	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.4 %	2.2 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.4 %</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.

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

**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
<b>Sector Financiero**</b>	41	136	5691	5937	40	113	4290	4935	29	80	4050	4738
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	3557	3063	0	0	2758	1176	0	0	2596	886
<b>Otros</b>	136	41	944	1191	113	40	516	1453	80	29	799	1821
<b>Total</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>10191</b>	<b>10191</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>7564</b>	<b>7564</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>7445</b>	<b>7445</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.