

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 25 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\$4466.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	604.2	615.6	295.9	567.8	300.7	17.4	19.0
15-35	1246.8	631.2	531.1	799.4	11.8	359.0	88.4
36-60	13.2	175.4	168.0	0.0	7.4	13.2	0.0
61-90	49.4	536.7	489.7	0.4	7.0	9.0	40.0
91-180	312.2	219.6	208.4	0.3	11.2	312.0	0.0
>180	197.0	47.3	10.0	134.9	2.3	27.1	35.0
<b>Total</b>	<b>2422.9</b>	<b>2225.9</b>	<b>1703.1</b>	<b>1502.8</b>	<b>340.4</b>	<b>737.7</b>	<b>182.4</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	2.2 %	1.7 %	1.9 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.4 %	2.2 %	2.2 %
61-90	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
91-180	-	2.5 %	2.0 %	2.0 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.1 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</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	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	141	5346	5666	39	115	5053	5902	16	83	4224	4904
Intragrupa y off-shore***	0	0	3146	2000	0	0	3284	1685	0	0	3274	1340
Otros	141	38	628	1454	115	39	1138	1888	83	16	500	1754
<b>Total</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>9120</b>	<b>9120</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>9475</b>	<b>9475</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>7998</b>	<b>7998</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.