

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

| Sectores                  | 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.