

**Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2020**

**Fecha de Información: 18 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\$2106.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	435.7	413.7	297.0	328.0	23.2	14.2	93.5
15-35	468.9	725.0	658.2	279.7	33.8	156.2	33.0
36-60	7.8	102.5	55.0	0.0	42.5	2.8	5.0
61-90	5.0	2.1	0.0	0.0	2.1	5.0	0.0
91-180	64.0	13.5	0.0	0.0	8.5	59.0	5.0
>180	3.0	1.5	0.0	0.0	1.5	3.0	0.0
<b>Total</b>	<b>984.4</b>	<b>1258.3</b>	<b>1010.2</b>	<b>607.7</b>	<b>111.6</b>	<b>240.2</b>	<b>136.5</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	
3-14	2.9 %	3.1 %	2.9 %	2.9 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.7 %	2.8 %
36-60	2.8 %	2.8 %	2.2 %	2.8 %
61-90	-	3.0 %	2.6 %	2.7 %
91-180	2.6 %	2.9 %	2.5 %	2.6 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.9 %</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	17 al 21 de agosto				24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	351	4641	4513	30	121	5172	5638	16	97	2551	3137
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2816	2043	0	0	2941	1609	1	0	2172	841
Otros	351	40	429	1328	121	30	703	1570	96	16	300	1044
Total	<b>391</b>	<b>391</b>	<b>7886</b>	<b>7884</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>8817</b>	<b>8817</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>5023</b>	<b>5023</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.