

**Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2020**

**Fecha de Información: 24 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\$1578.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.<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	362.0	311.5	135.8	181.3	4.9	9.9	170.8
15-35	394.9	637.8	408.5	131.0	8.4	42.9	221.0
36-60	40.5	51.5	40.4	0.0	11.2	40.5	0.0
61-90	8.8	17.5	0.0	5.8	17.5	3.0	0.0
91-180	88.6	79.6	29.0	30.0	5.6	13.6	45.0
>180	17.9	4.3	0.0	0.2	4.3	17.7	0.0
<b>Total</b>	<b>912.8</b>	<b>1102.2</b>	<b>613.6</b>	<b>348.3</b>	<b>51.9</b>	<b>127.7</b>	<b>436.8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.9 %	2.8 %	1.1 %	2.1 %
15-35	2.9 %	2.9 %	3.2 %	3.0 %
36-60	-	2.9 %	2.7 %	2.8 %
61-90	-	2.9 %	2.6 %	2.8 %
91-180	2.6 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.4 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.7 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

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

Sectores	24 al 28 de agosto				31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	31	133	5986	6848	110	164	2766	3338	13	71	5158	5481
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3751	2015	1	0	2265	947	0	0	3229	1670
<b>Otros</b>	133	31	736	1610	163	110	305	1051	71	13	407	1644
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>10473</b>	<b>10473</b>	<b>274</b>	<b>274</b>	<b>5336</b>	<b>5336</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>8795</b>	<b>8795</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.