

**Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2020**

**Fecha de Información: 26 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\$2842.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.<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	370.9	688.3	254.5	262.5	351.8	26.3	82.0
15-35	749.6	502.4	224.8	222.8	122.1	371.4	155.5
36-60	214.2	15.6	0.0	29.8	15.6	184.4	0.0
61-90	131.2	181.0	55.0	0.0	12.0	17.2	114.0
91-180	175.8	291.6	125.0	0.0	7.6	16.8	159.0
>180	28.4	3.5	0.0	20.0	3.5	8.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1670.1</b>	<b>1682.4</b>	<b>659.3</b>	<b>535.0</b>	<b>512.6</b>	<b>624.6</b>	<b>510.5</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 %	2.8 %	2.4 %	2.7 %
15-35	2.8 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	2.9 %	2.7 %	2.7 %
61-90	2.7 %	2.7 %	2.5 %	2.7 %
91-180	2.6 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
>180	-	2.7 %	2.2 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.8 %</b>	<b>2.7 %</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: ((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	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>	34	157	6609	7357	131	200	3008	3797	14	71	5364	5687
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	3809	2515	1	0	2625	1090	0	0	3304	1738
<b>Otros</b>	157	34	1084	1629	199	131	315	1060	71	14	409	1652
<b>Total</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>11501</b>	<b>11501</b>	<b>331</b>	<b>331</b>	<b>5947</b>	<b>5947</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>9077</b>	<b>9077</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.