

**Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2020**

**Fecha de Información: 27 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\$2168.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.<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	476.0	495.6	269.0	284.1	74.6	39.9	152.0
15-35	626.0	475.4	237.0	310.6	98.4	175.5	140.0
36-60	22.4	75.0	46.1	0.0	28.9	22.4	0.0
61-90	13.8	162.4	130.0	0.0	32.4	13.8	0.0
91-180	16.6	33.5	0.0	0.0	33.5	16.6	0.0
>180	43.5	60.4	0.0	0.1	20.4	3.4	40.0
<b>Total</b>	<b>1198.4</b>	<b>1302.3</b>	<b>682.1</b>	<b>594.8</b>	<b>288.2</b>	<b>271.6</b>	<b>332.0</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	2.6 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.8 %	2.5 %	2.7 %
61-90	-	2.6 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	3.0 %	2.4 %	2.8 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.7 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.6 %</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 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>	33	165	6703	7481	134	199	3285	4036	17	70	5462	5821
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3821	2554	1	0	2797	1285	0	0	3389	1788
<b>Otros</b>	165	33	1137	1625	198	134	332	1092	70	17	415	1657
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>11660</b>	<b>11660</b>	<b>332</b>	<b>332</b>	<b>6414</b>	<b>6414</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>9266</b>	<b>9266</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.