

Fecha de Publicación: 2 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 31 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\$2059.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	567.2	584.4	137.0	454.3	343.4	8.8	104.0
15-35	171.1	486.8	357.0	45.7	30.2	25.8	99.6
36-60	239.3	42.6	20.0	0.0	12.6	229.3	10.0
61-90	122.9	10.0	0.0	0.0	10.0	122.9	0.0
91-180	16.8	36.4	0.0	0.0	21.4	1.8	15.0
>180	6.7	3.7	0.0	5.0	3.7	1.7	0.0
<b>Total</b>	<b>1124.1</b>	<b>1163.9</b>	<b>514.0</b>	<b>505.0</b>	<b>421.3</b>	<b>390.4</b>	<b>228.6</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	2.4 %	2.4 %	1.7 %	2.1 %
15-35	2.5 %	2.6 %	1.9 %	2.5 %
36-60	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	3.1 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.7 %	2.2 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.3 %</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	31 de ago. al 4 de septiembre				7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	139	209	3973	4716	18	74	5660	5979	40	103	3285	4435
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	1	0	2977	1796	0	0	3454	1904	0	0	2852	1258
<b>Otros</b>	208	139	657	1095	74	18	435	1666	103	40	665	1109
<b>Total</b>	<b>348</b>	<b>348</b>	<b>7607</b>	<b>7607</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>9549</b>	<b>9549</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>6802</b>	<b>6802</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.