

**Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2020**

**Fecha de Información: 08 de septiembre 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\$2427.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<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	715.7	411.1	76.5	633.8	277.7	24.9	57.0
15-35	208.2	723.5	647.9	78.3	9.6	63.9	66.0
36-60	77.0	12.4	0.0	0.0	6.4	71.0	6.0
61-90	179.0	33.6	30.0	0.0	3.6	179.0	0.0
91-180	94.2	69.9	64.5	0.0	5.4	94.2	0.0
>180	28.6	7.3	0.0	21.7	3.3	2.8	4.0
<b>Total</b>	<b>1302.7</b>	<b>1257.8</b>	<b>818.8</b>	<b>733.9</b>	<b>306.0</b>	<b>435.8</b>	<b>133.0</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	2.5 %	1.4 %	2.1 %	1.9 %
15-35	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
36-60	2.3 %	2.8 %	2.3 %	2.3 %
61-90	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.2 %</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	7 al 11 de septiembre				14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	104	7367	7745	44	114	3760	4964	38	108	3685	3728
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	4166	3100	0	0	3139	1492	0	0	2053	1064
<b>Otros</b>	104	21	1015	1703	114	44	706	1149	108	38	446	1392
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>12548</b>	<b>12548</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>7605</b>	<b>7605</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6184</b>	<b>6184</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.