

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 09 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\$1851.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.<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	552.3	191.3	97.0	460.6	21.3	18.7	73.0
15-35	601.4	520.7	302.7	156.8	37.5	264.2	180.5
36-60	48.7	6.9	0.9	0.0	5.9	48.7	0.0
61-90	12.0	3.3	0.0	0.0	3.3	12.0	0.0
91-180	23.6	147.2	133.0	0.0	4.2	13.6	10.0
>180	3.2	4.2	0.0	0.6	4.2	2.6	0.0
<b>Total</b>	<b>1241.1</b>	<b>873.6</b>	<b>533.6</b>	<b>618.0</b>	<b>76.5</b>	<b>359.7</b>	<b>263.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	2.6 %	2.3 %	2.3 %
15-35	2.5 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.8 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-	2.7 %	2.3 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.5 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.4 %</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>	27	136	7679	7848	42	123	3989	5026	38	106	3708	3753
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	4197	3335	0	0	3190	1716	0	0	2068	1066
<b>Otros</b>	136	27	1014	1707	123	42	717	1154	106	38	456	1413
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>12890</b>	<b>12890</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>7896</b>	<b>7896</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>6232</b>	<b>6232</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.