

**Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2020**

**Fecha de Información: 15 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\$2132.8 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	648.5	416.6	89.2	350.2	41.7	12.5	285.7
15-35	406.7	751.0	560.3	97.5	73.7	192.2	117.0
36-60	19.3	39.1	18.9	0.0	5.1	4.3	15.0
61-90	71.7	45.0	7.8	0.0	37.2	71.7	0.0
91-180	31.5	37.5	20.0	10.0	17.5	21.5	0.0
>180	30.9	57.8	40.0	0.0	12.8	25.9	5.0
<b>Total</b>	<b>1208.5</b>	<b>1346.9</b>	<b>736.2</b>	<b>457.7</b>	<b>188.0</b>	<b>328.1</b>	<b>422.7</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 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.4 %		2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.5 %		2.8 %	2.0 %	2.5 %
61-90	-		2.5 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-		2.5 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.3 %		2.3 %	2.1 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>		<b>2.4 %</b>	<b>2.2 %</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	14 al 18 de septiembre				21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	131	5338	5745	38	109	4065	4687	26	89	3848	4375
Intragrupo y off-shore***	0	0	3524	2753	0	0	2693	1121	0	0	2426	876
Otros	131	38	813	1177	109	38	488	1438	89	26	779	1802
<b>Total</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>9675</b>	<b>9675</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>7246</b>	<b>7246</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>7052</b>	<b>7052</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.