

**Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2020**

**Fecha de Información: 21 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\$1686.7 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	346.2	452.4	342.7	225.0	2.7	14.2	107.0
15-35	393.2	282.2	209.8	179.7	36.4	177.5	36.0
36-60	39.9	189.6	187.8	29.1	1.8	10.9	0.0
61-90	21.6	25.7	10.0	2.1	15.7	19.5	0.0
91-180	60.7	37.0	0.0	30.0	12.0	5.7	25.0
>180	4.4	1.8	0.0	0.7	1.8	3.8	0.0
<b>Total</b>	<b>866.0</b>	<b>988.7</b>	<b>750.2</b>	<b>466.5</b>	<b>70.5</b>	<b>231.5</b>	<b>168.0</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	
3-14	2.4 %	2.1 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.3 %
61-90	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
91-180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.3 %</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	21 al 25 de septiembre				28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	125	4776	5173	31	83	4251	5061	14	88	3989	4684
Intragrupo y off-shore***	0	0	2963	1611	0	0	2820	990	0	0	3133	1191
Otros	125	47	502	1456	83	31	812	1832	88	14	484	1731
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>8241</b>	<b>8241</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>7883</b>	<b>7883</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>7606</b>	<b>7606</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.