

**Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 29 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\$3427.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	480.0	315.5	184.5	351.8	6.9	4.1	124.2
15-35	1258.3	786.9	438.2	585.0	234.7	559.3	114.0
36-60	89.1	355.9	300.0	0.6	15.9	48.4	40.0
61-90	35.2	46.3	0.0	0.0	46.3	35.2	0.0
91-180	40.6	241.8	230.0	10.0	11.8	30.6	0.0
>180	49.3	12.2	4.0	35.0	2.2	8.3	6.0
<b>Total</b>	<b>1952.5</b>	<b>1758.7</b>	<b>1156.7</b>	<b>982.4</b>	<b>317.8</b>	<b>685.9</b>	<b>284.2</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	2.1 %		1.6 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.1 %		2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.0 %		2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-		2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-		2.3 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.2 %		2.7 %	2.1 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>		<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.1 %</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	28 de sep. al 2 de octubre				5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	139	6006	6279	22	80	4489	5133	31	98	3802	4030
Intragrupo y off-shore***	3	0	3374	2427	0	0	3416	1537	0	0	2363	607
Otros	136	46	1208	1882	80	22	525	1760	98	31	739	2267
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>10588</b>	<b>10588</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>8429</b>	<b>8429</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>6904</b>	<b>6904</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.