

**Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 30 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\$3455.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<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	1010.6	231.2	159.8	913.8	9.4	34.8	62.0
15-35	617.4	1200.9	919.8	268.8	187.2	254.6	94.0
36-60	4.1	99.0	72.0	0.0	27.0	4.1	0.0
61-90	112.8	102.3	70.0	95.0	17.3	2.8	15.0
91-180	25.2	16.4	0.0	0.0	16.4	25.2	0.0
>180	94.4	134.1	110.0	61.1	2.6	11.8	21.5
<b>Total</b>	<b>1864.5</b>	<b>1783.9</b>	<b>1331.6</b>	<b>1338.7</b>	<b>259.9</b>	<b>333.3</b>	<b>192.5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	1.9 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.0 %	1.5 %	2.0 %
61-90	1.9 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.3 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.1 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	47	141	6233	6309	22	82	5255	5213	32	99	3836	4156
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	3	0	3392	2643	0	0	3447	2234	0	0	2473	608
<b>Otros</b>	138	47	1210	1883	82	22	531	1787	99	32	740	2285
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>10835</b>	<b>10835</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>9234</b>	<b>9234</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>7049</b>	<b>7049</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.