

**Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 05 de octubre 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\$2818.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	505.1	576.1	341.6	291.0	63.5	43.2	170.9
15-35	1056.1	722.1	359.5	336.9	209.1	565.7	153.5
36-60	5.1	36.3	20.0	0.0	16.3	5.1	0.0
61-90	1.4	5.2	0.0	0.0	5.2	1.4	0.0
91-180	78.0	65.5	50.0	12.5	5.5	55.5	10.0
>180	90.4	81.2	10.0	20.0	1.2	0.4	70.0
<b>Total</b>	<b>1736.1</b>	<b>1486.3</b>	<b>781.1</b>	<b>660.4</b>	<b>300.8</b>	<b>671.4</b>	<b>404.4</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.9 %
61-90	-	2.4 %	1.7 %	2.3 %
91-180	1.8 %	1.8 %	1.9 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.7 %</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	5 al 9 de octubre				12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	93	6221	6108	32	97	4140	4670	38	105	4907	5037
Intragruo y off-shore***	0	0	3991	2906	0	0	2829	786	0	0	3091	1297
Otros	93	33	645	1844	97	32	799	2312	105	38	980	2644
<b>Total</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>10858</b>	<b>10858</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>7768</b>	<b>7768</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>8978</b>	<b>8978</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 intragruo.