

**Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 13 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\$3232.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	820.6	652.0	182.9	748.3	407.1	10.4	62.0
15-35	351.7	820.4	736.3	145.1	32.7	155.1	51.5
36-60	469.4	89.7	30.0	0.0	9.7	419.4	50.0
61-90	3.7	2.5	1.4	2.4	1.1	1.3	0.0
91-180	35.3	77.6	50.0	0.0	17.6	25.3	10.0
>180	55.8	54.0	26.0	0.0	1.0	28.8	27.0
<b>Total</b>	<b>1736.6</b>	<b>1696.2</b>	<b>1026.5</b>	<b>895.7</b>	<b>469.2</b>	<b>640.3</b>	<b>200.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.2 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	1.6 %	2.0 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.9 %	1.9 %
61-90	-	2.6 %	1.7 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.4 %	2.0 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</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	12 al 16 de octubre				19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	112	5320	5506	42	102	5137	5767	46	119	5348	5948
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3019	1795	0	0	3322	1411	19	0	3587	1862
<b>Otros</b>	112	39	1324	2362	102	41	1387	2668	100	46	735	1859
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>9663</b>	<b>9663</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>9846</b>	<b>9846</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>9669</b>	<b>9669</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 intragruppo.