

**Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 20 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\$2919.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	605.3	328.0	118.6	394.1	25.7	27.5	183.7
15-35	1079.5	664.8	185.5	256.3	338.3	682.2	141.0
36-60	74.0	114.2	50.0	0.0	24.2	34.0	40.0
61-90	6.2	22.8	0.0	0.0	22.8	6.2	0.0
91-180	70.4	258.6	184.4	35.0	39.2	0.4	35.0
>180	66.0	59.6	0.0	10.0	29.6	26.0	30.0
<b>Total</b>	<b>1901.4</b>	<b>1448.0</b>	<b>538.5</b>	<b>695.4</b>	<b>479.9</b>	<b>776.3</b>	<b>429.6</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	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
36-60	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</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	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	115	7286	6543	51	120	6020	6636	24	77	3909	4111
Intragruo y off-shore***	0	0	3609	3011	19	0	3765	2300	0	0	2453	1608
Otros	115	51	1430	2771	101	51	1059	1909	77	24	572	1216
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>12325</b>	<b>12325</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>10845</b>	<b>10845</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>6935</b>	<b>6935</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.