

**Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2020**

**Fecha de Información: 27 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\$2225.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	436.5	71.9	43.7	338.4	1.3	71.2	26.9
15-35	725.8	814.9	374.0	203.7	299.1	380.2	141.9
36-60	63.2	41.4	0.0	0.8	4.0	25.1	37.4
61-90	24.9	7.8	0.0	0.0	7.8	24.9	0.0
91-180	56.0	91.5	27.0	0.0	44.5	36.0	20.0
>180	36.8	115.0	80.6	0.0	0.4	2.8	34.0
<b>Total</b>	<b>1343.4</b>	<b>1142.5</b>	<b>525.3</b>	<b>542.9</b>	<b>357.0</b>	<b>540.3</b>	<b>260.2</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	1.6 %		1.8 %	1.7 %	1.7 %
15-35	1.7 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %		2.0 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-		1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.7 %		1.8 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.1 %		1.8 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>		<b>1.8 %</b>	<b>1.6 %</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	26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	133	7656	7590	139	80	4266	4381	24	90	3640	3903
Intragrupo y off-shore***	19	0	4261	3390	0	0	2509	1687	0	0	2445	1564
Otros	114	32	1100	2037	80	139	578	1285	90	24	563	1180
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>13017</b>	<b>13017</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>7353</b>	<b>7353</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>6648</b>	<b>6648</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.