

**Fecha de Publicación: 4 de noviembre de 2020**

**Fecha de Información: 30 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\$1506.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	177.5	131.8	87.2	136.1	9.6	6.4	35.0
15-35	393.1	664.5	465.1	162.5	62.9	94.1	136.5
36-60	77.4	74.0	15.0	0.0	14.0	32.4	45.0
61-90	63.1	16.9	0.0	0.0	16.9	63.1	0.0
91-180	20.7	55.6	30.0	0.0	10.6	5.7	15.0
>180	32.1	61.2	25.0	0.0	6.2	2.1	30.0
<b>Total</b>	<b>763.9</b>	<b>1004.0</b>	<b>622.3</b>	<b>298.6</b>	<b>120.2</b>	<b>203.8</b>	<b>261.5</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	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.0 %	-2.1 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	44	145	7995	7927	137	78	4904	4644	29	89	3815	4064
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	19	0	4476	3657	0	0	2637	2170	0	0	2501	1604
<b>Otros</b>	126	44	1146	2034	78	137	591	1318	89	29	571	1218
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>13618</b>	<b>13618</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>8132</b>	<b>8132</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>6887</b>	<b>6887</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.