

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 06 de noviembre 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\$2032.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	481.2	302.4	52.9	263.7	36.0	4.0	213.5
15-35	828.3	709.4	267.0	384.0	39.4	41.3	403.0
36-60	1.8	40.2	0.0	0.0	40.2	1.8	0.0
61-90	38.4	69.6	10.0	0.0	39.6	18.4	20.0
91-180	39.0	137.4	40.9	3.9	76.5	15.1	20.0
>180	24.5	32.2	2.4	5.0	13.8	3.5	16.0
<b>Total</b>	<b>1413.2</b>	<b>1291.4</b>	<b>373.3</b>	<b>656.6</b>	<b>245.6</b>	<b>84.2</b>	<b>672.5</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	11.7 %	1.6 %	1.5 %	6.3 %
15-35	2.8 %	1.8 %	1.5 %	2.2 %
36-60	-	2.0 %	1.2 %	1.9 %
61-90	3.3 %	2.2 %	1.6 %	2.3 %
91-180	4.0 %	1.9 %	1.7 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>3.3 %</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	2 al 6 de noviembre				9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	151	75	5474	4901	37	111	4505	4417	29	130	5291	5016
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2863	2645	0	0	2598	2006	0	0	2392	1416
<b>Otros</b>	75	151	532	1324	111	37	581	1261	130	29	1200	2452
<b>Total</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>8869</b>	<b>8869</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>7684</b>	<b>7684</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>8883</b>	<b>8883</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.