

**Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2020**

**Fecha de Información: 11 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\$1100.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	551.9	419.3	27.0	169.0	30.3	20.9	362.0
15-35	216.3	208.5	156.0	163.5	9.0	9.3	43.5
36-60	0.5	7.0	0.0	0.0	7.0	0.5	0.0
61-90	1.2	42.0	24.3	0.0	17.7	1.2	0.0
91-180	19.1	20.9	0.0	18.5	20.9	0.6	0.0
>180	2.3	16.5	5.0	0.0	11.5	2.3	0.0
<b>Total</b>	<b>791.4</b>	<b>714.2</b>	<b>212.4</b>	<b>351.0</b>	<b>96.3</b>	<b>34.9</b>	<b>405.5</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 %	1.6 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	2.2 %	0.4 %	2.1 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	2.1 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.3 %</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	9 al 13 de noviembre				16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	58	139	5515	4678	34	149	5884	5460	29	178	5392	5873
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2804	2859	0	0	2430	1661	0	3	2989	1420
<b>Otros</b>	139	58	582	1364	149	34	1304	2497	178	26	1197	2286
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>8901</b>	<b>8901</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>9618</b>	<b>9618</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>9579</b>	<b>9579</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.