

**Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2020**

**Fecha de Información: 19 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\$4233.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	641.3	969.6	128.5	246.6	511.4	65.0	329.7
15-35	937.2	771.8	415.0	375.0	25.8	231.2	331.0
36-60	2.8	9.0	0.0	0.0	9.0	2.8	0.0
61-90	1092.0	261.6	40.0	111.0	86.6	846.0	135.0
91-180	77.6	269.0	175.0	0.0	19.0	2.6	75.0
>180	30.1	72.0	40.0	0.0	2.0	0.1	30.0
<b>Total</b>	<b>2781.0</b>	<b>2352.9</b>	<b>798.5</b>	<b>732.7</b>	<b>653.7</b>	<b>1147.6</b>	<b>900.7</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	1.6 %	1.2 %	1.0 %	1.3 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	2.0 %	1.3 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.3 %	1.6 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.6 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.5 %</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	16 al 20 de noviembre				23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	52	156	7769	6320	41	131	6235	7082	34	124	4559	4458
<b>Intragruo y off-shore***</b>	0	0	2753	3123	0	3	3161	1826	0	0	2473	1868
<b>Otros</b>	156	52	1589	2668	131	38	1837	2326	124	34	441	1147
<b>Total</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>12111</b>	<b>12111</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>11233</b>	<b>11233</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>7473</b>	<b>7473</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.