

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2020

Fecha de Información: 25 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\$3028.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	560.6	430.7	251.9	393.5	71.8	60.2	106.9
15-35	667.4	720.1	419.1	363.4	42.8	45.9	258.2
36-60	207.6	42.9	17.0	15.0	25.5	192.2	0.4
61-90	269.7	108.7	10.0	28.7	71.7	214.0	27.0
91-180	76.6	286.6	128.6	0.0	113.0	31.6	45.0
>180	16.3	83.3	37.0	0.0	41.3	11.3	5.0
<b>Total</b>	<b>1798.2</b>	<b>1672.4</b>	<b>863.6</b>	<b>800.6</b>	<b>366.3</b>	<b>555.1</b>	<b>442.5</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	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.6 %	2.0 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
>180	2.0 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %
<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	23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	56	164	8296	7911	44	120	5304	5511	24	171	3559	3627
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	3	3439	3254	0	0	2775	2269	10	0	2148	1690
<b>Otros</b>	164	53	1868	2438	120	44	903	1202	161	24	453	827
<b>Total</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>13603</b>	<b>13603</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>8981</b>	<b>8981</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>6160</b>	<b>6144</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.