

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2020

Fecha de Información: 02 de diciembre 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\$2737.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	583.7	517.9	274.7	338.0	70.2	72.7	173.0
15-35	542.3	409.5	313.5	445.7	21.0	21.7	75.0
36-60	172.1	51.3	30.8	97.0	20.5	75.1	0.0
61-90	162.2	97.1	35.0	35.0	52.1	117.2	10.0
91-180	113.1	180.0	117.2	100.0	62.8	13.1	0.0
>180	22.0	148.1	100.0	0.0	44.1	18.0	4.0
<b>Total</b>	<b>1595.5</b>	<b>1403.9</b>	<b>871.2</b>	<b>1015.7</b>	<b>270.7</b>	<b>317.8</b>	<b>262.0</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	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.4 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</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**

Sector	30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre				14 al 18 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	58	133	6359	6274	34	183	4212	4235	42	214	5986	5962
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3087	2812	10	0	2252	1919	0	0	3407	2524
<b>Otros</b>	133	58	1020	1381	173	34	561	855	214	42	477	1367
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>10466</b>	<b>10466</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>7025</b>	<b>7009</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>9869</b>	<b>9853</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 intragruppo.