

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 09 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2051 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.49%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Interbancarios
3-14	438,8	461,8	269,7	243,2	102,6	106,1	89,5
15-35	314,6	526,0	403,2	143,3	20,8	69,3	102,0
36-60	164,1	44,5	11,0	143,8	18,5	5,3	15,0
61-90	123,6	133,1	61,0	31,0	12,6	33,1	59,5
91-180	34,2	46,8	24,4	31,0	22,4	3,2	0,0
>180	20,3	19,5	1,7	10,0	7,9	0,3	10,0
Total	1095,5	1231,7	771,1	602,3	184,7	217,2	276,0

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero ^a		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.44%		1.49%	1.68%	1.56%
15-35	1.45%		1.45%	1.36%	1.43%
36-60	1.20%		1.55%	1.37%	1.38%
61-90	1.39%		1.59%	1.40%	1.45%
91-180	—		1.76%	1.57%	1.64%
>180	1.85%		2.10%	0.99%	1.94%
Total	1.43%		1.50%	1.51%	1.49%

^a Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

² 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	07 – 11 dic.				14 - 18 dic.				21 - 25 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	35	155	4138	4007	46	226	7063	7230	23	122	3798	4132
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2126	1935	0	0	3965	3316	0	0	2385	2084
Otros ^c	155	35	624	946	226	46	943	1425	122	23	292	258
Total	190	190	6888	6888	272	272	11971	11971	145	145	6475	6474

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.