

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2020**  
**Fecha de Información: 14 de diciembre de 2020<sup>1</sup>**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1479 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.33%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Interbancarios
3-14	360,9	252,4	138,6	244,4	52,8	55,4	61
15-35	395,2	448,0	313,7	204,5	20,3	76,7	114
36-60	30,3	28,5	8,0	20,0	20,5	10,3	0
61-90	15,4	26,0	5,1	10,0	20,9	5,4	0
91-180	8,5	26,5	0,0	0,0	26,5	8,5	0
>180	14,7	50,9	30,0	10,0	17,9	1,7	3
<b>Total</b>	<b>825,1</b>	<b>832,3</b>	<b>495,4</b>	<b>488,9</b>	<b>158,9</b>	<b>158,2</b>	<b>178</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.31%		1.27%	0.99%	1.19%
15-35	1.40%		1.38%	1.24%	1.32%
36-60	—		1.44%	1.10%	1.35%
61-90	—		1.67%	1.46%	1.59%
91-180	—		1.80%	1.46%	1.72%
>180	2.29%		1.92%	1.65%	1.93%
<b>Total</b>	<b>1.38%</b>		<b>1.44%</b>	<b>1.19%</b>	<b>1.33%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones interbancarias

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

<sup>1</sup> 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.

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	14 – 18 dic.				21 - 25 dic.				28 dic. - 01 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	56	230	7758	7731	21	119	3920	4290	13	116	2084	2485
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4217	3786	0	0	2439	2149	0	0	1629	1310
Otros <sup>c</sup>	230	56	1147	1605	119	21	344	264	116	13	265	184
<b>Total</b>	<b>286</b>	<b>286</b>	<b>13122</b>	<b>13122</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>6703</b>	<b>6703</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>3978</b>	<b>3979</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.