

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 16 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2829 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.20%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	825,9	242,8	148,8	704,5	78,0	105,4	16
15-35	485,8	872,9	670,4	270,5	33,5	46,3	169
36-60	73,9	56,7	37,4	20,0	19,3	53,9	0
61-90	73,1	112,3	50,7	23,0	21,6	10,1	40
91-180	7,5	16,2	4,2	0,0	12,0	7,5	0
>180	141,5	211,5	63,5	73,0	82,1	2,5	66
Total	1607,6	1512,4	974,9	1090,9	246,5	225,6	291

^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	1.37%		1.25%	0.70%	0.85%
15-35	1.23%		1.20%	1.16%	1.19%
36-60	—		1.45%	1.27%	1.30%
61-90	1.55%		1.57%	1.52%	1.55%
91-180	—		1.96%	1.32%	1.72%
>180	1.78%		2.06%	2.12%	2.00%
Total	1.41%		1.35%	1.00%	1.20%

^a Incluye solo operaciones interbancarias

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

¹Datos provisionales.

²El 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 ^a	33	175	4619	4300	22	121	4417	4593	14	116	2146	2493
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2172	2228	0	0	2548	2581	0	0	1630	1341
Otros ^c	175	33	649	913	121	22	479	270	116	14	270	213
Total	208	208	7440	7441	143	143	7444	7444	130	130	4046	4047

^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.