

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2020**  
**Fecha de Información: 17 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\$1975 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.35%<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	356,7	243,8	110,0	231,2	95,8	87,5	38
15-35	558,5	607,6	433,1	336,0	23,6	71,5	151
36-60	53,0	8,3	0,3	0,0	8,0	53,0	0
61-90	136,8	33,2	0,0	0,0	13,2	116,8	20
91-180	7,4	32,6	20,0	0,0	12,6	7,4	0
>180	50,9	124,9	59,0	20,0	35,9	0,9	30
<b>Total</b>	<b>1163,3</b>	<b>1050,6</b>	<b>622,5</b>	<b>587,2</b>	<b>189,1</b>	<b>337,0</b>	<b>239</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	1.34%		0.74%	1.78%	1.31%
15-35	1.22%		1.10%	1.13%	1.15%
36-60	–		1.63%	1.18%	1.24%
61-90	1.33%		1.72%	1.40%	1.42%
91-180	–		1.72%	1.46%	1.67%
>180	2.17%		2.17%	2.51%	2.22%
<b>Total</b>	<b>1.37%</b>		<b>1.31%</b>	<b>1.38%</b>	<b>1.35%</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>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) ^ (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>	24	73	3554	3196	23	122	4552	4689	16	112	2159	2605
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1683	1834	0	0	2613	2686	0	0	1661	1343
Otros <sup>c</sup>	73	24	467	673	122	23	483	273	112	16	341	214
<b>Total</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>5704</b>	<b>5703</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>7648</b>	<b>7648</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>4161</b>	<b>4162</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.