

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 18 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1798 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.25%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292,0	92,2	55,9	213,1	26,3	68,9	10,0
15-35	413,4	519,8	414,4	358,4	70,8	20,5	34,5
36-60	25,1	52,8	23,0	0,0	6,8	2,1	23,0
61-90	7,4	136,7	115,0	0,0	21,7	7,4	0,0
91-180	8,6	29,2	10,0	0,0	17,2	6,6	2,0
>180	194,8	118,4	78,1	170,1	17,4	1,7	23,0
Total	941,3	949,2	696,4	741,6	160,3	107,2	92,5

^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	0.96%	1.19%	0.99%	1.04%
15-35	0.93%	1.01%	1.01%	1.01%
36-60	0.81%	1.08%	1.00%	0.96%
61-90	–	1.51%	1.15%	1.43%
91-180	1.93%	1.91%	1.58%	1.83%
>180	2.05%	1.99%	1.99%	1.99%
Total	1.20%	1.23%	1.27%	1.25%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	15	45	725	582	23	135	4731	4734	15	129	2201	2646
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	296	437	0	0	2633	2803	0	0	1686	1371
Otros ^c	45	15	177	179	135	23	507	335	129	15	347	217
Total	60	60	1198	1198	158	158	7871	7872	144	144	4234	4234

^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.