

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 21 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1691 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.69%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	456,2	164,2	101,2	349,7	12,0	55,5	51
15-35	373,8	599,7	476,5	130,5	76,2	196,3	47
36-60	6,0	9,1	0,0	0,0	9,1	6,0	0
61-90	52,2	18,1	0,0	2,5	18,1	49,7	0
91-180	6,1	83,9	0,0	0,0	83,9	6,1	0
>180	6,2	14,0	4,3	0,0	9,7	6,2	0
Total	900,5	888,9	582,0	482,7	208,9	319,8	98

^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	Compras	Ventas	
3-14	0.37%	0.71%		0.57%	0.57%
15-35	0.52%	0.67%	282183740490850370884484202004428242482008.00%	0.54%	
36-60	—	1.24%		0.76%	1.05%
61-90	—	1.44%		1.19%	1.26%
91-180	—	1.75%		1.48%	1.73%
>180	—	2.27%		2.04%	2.18%
Total	0.44%	0.89%		0.55%	0.69%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	21 – 25 dic.				28 dic. - 01 ene.				04 - 08 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	139	5034	4791	15	130	2348	2726	16	88	3412	3517
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2680	3051	0	0	1719	1466	0	0	2262	1779
Otros ^c	139	25	512	384	130	15	350	225	88	16	322	701
Total	164	164	8226	8226	145	145	4417	4417	104	104	5996	5997

^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.