

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 22 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1935 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.55%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	319,8	250,8	194,8	228,1	5,7	41,4	50,3
15-35	596,6	797,1	525,6	376,3	84,5	33,3	187,0
36-60	11,2	34,3	0,8	0,0	33,5	11,2	0,0
61-90	33,2	60,0	30,0	0,2	30,0	33,0	0,0
91-180	3,8	26,6	6,2	0,0	20,4	3,8	0,0
>180	27,4	32,0	3,0	0,0	8,7	7,1	20,4
Total	992,0	1200,7	760,5	604,6	182,6	129,7	257,7

^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	0.22%		0.35%	64722.87%	0.49%
15-35	0.35%		0.42%	0.28%	0.36%
36-60	—		0.88%	0.42%	0.77%
61-90	—		1.00%	1.18%	1.06%
91-180	—		1.81%	0.90%	1.67%
>180	1.88%		2.58%	1.95%	2.06%
Total	0.45%		0.61%	0.55%	0.55%

^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	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	36	96	3894	3562	16	131	2385	2787	16	117	3615	3613
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2213	2628	0	0	1774	1499	0	0	2297	1934
Otros ^c	96	36	374	291	131	16	354	227	117	16	336	701
Total	132	132	6481	6481	147	147	4513	4513	133	133	6248	6248

^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.