

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2020**  
**Fecha de Información: 24 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\$675 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.27%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	260,3	41,6	36,0	248,0	4,6	11,3	1,0
15-35	164,1	106,7	78,5	129,0	5,4	12,3	22,7
36-60	2,0	6,6	0,0	0,0	6,6	2,0	0,0
61-90	2,2	28,7	15,0	1,1	13,7	1,1	0,0
91-180	11,9	44,4	30,0	0,0	4,4	1,9	10,0
>180	3,3	36,4	35,0	0,0	1,4	3,3	0,0
<b>Total</b>	<b>443,9</b>	<b>264,4</b>	<b>194,5</b>	<b>378,1</b>	<b>36,2</b>	<b>32,0</b>	<b>33,7</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	0.00%	0.08%	-0.78%	-0.60%
15-35	0.11%	0.17%	0.02%	0.08%
36-60	-	1.09%	-0.44%	0.73%
61-90	-	0.83%	-0.19%	0.79%
91-180	0.88%	1.07%	1.00%	1.03%
>180	-	1.82%	1.50%	1.80%
<b>Total</b>	<b>0.33%</b>	<b>0.81%</b>	<b>-0.25%</b>	<b>0.27%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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 <sup>a</sup>	12	10	350	242	18	129	2644	2891	16	120	3904	3752
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	109	229	0	0	1829	1676	0	0	2334	2150
Otros <sup>c</sup>	10	12	68	55	129	18	364	271	120	16	372	709
<b>Total</b>	<b>22</b>	<b>22</b>	<b>527</b>	<b>526</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>4837</b>	<b>4838</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6610</b>	<b>6611</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.