

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2020**  
**Fecha de Información: 28 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\$1050 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.08%<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	84,2	78,1	29,0	34,3	22,5	23,2	26,6
15-35	346,4	223,5	150,3	223,0	44,2	94,4	29,0
36-60	1,7	106,6	100,3	0,0	6,3	1,7	0,0
61-90	8,2	12,4	0,2	0,0	12,2	8,2	0,0
91-180	104,7	36,3	20,0	100,0	16,3	4,7	0,0
>180	1,9	102,2	100,0	0,0	2,2	1,9	0,0
<b>Total</b>	<b>547,0</b>	<b>559,0</b>	<b>399,8</b>	<b>357,3</b>	<b>103,6</b>	<b>134,1</b>	<b>55,6</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	-0.35%		0.00%	-0.18%	-0.17%
15-35	-0.08%		-0.10%	-0.49%	-0.35%
36-60	—		0.87%	0.16%	0.73%
61-90	—		1.06%	0.43%	0.80%
91-180	—		1.10%	0.85%	1.06%
>180	—		1.54%	1.46%	1.54%
<b>Total</b>	<b>-0.21%</b>		<b>0.65%</b>	<b>-0.40%</b>	<b>0.08%</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	28 dic. - 01 ene.				04 - 08 ene.				11 - 15 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	20	137	2711	2974	16	121	3944	3791	28	136	5290	4608
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1872	1707	0	0	2339	2170	0	0	2709	1891
Otros <sup>c</sup>	137	20	389	291	121	16	385	707	136	28	567	2068
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>4972</b>	<b>4972</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6668</b>	<b>6668</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>8566</b>	<b>8567</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.