

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 07 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1749 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.26%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	335,7	372,4	228,7	193,8	69,2	67,3	74,6
15-35	600,9	474,9	293,1	379,2	3,0	42,9	178,8
36-60	17,8	38,7	16,0	0,0	22,7	17,8	0,0
61-90	28,2	23,5	0,0	6,9	5,5	3,3	18,0
91-180	29,3	100,4	21,6	0,0	63,9	14,3	15,0
>180	10,1	3,1	0,0	10,0	3,1	0,1	0,0
Total	1022,0	1013,0	559,3	590,0	167,3	145,7	286,3

^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	1.31%	1.21%	1.12%	1.19%
15-35	1.27%	1.20%	1.15%	1.20%
36-60	–	1.57%	1.33%	1.47%
61-90	1.51%	1.74%	1.43%	1.52%
91-180	1.51%	1.86%	1.31%	1.72%
>180	–	1.92%	2.21%	2.14%
Total	1.31%	1.31%	1.17%	1.26%

^a Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

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	07 – 11 dic.				14 - 18 dic.				21 - 25 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	46	172	4784	4783	46	226	6951	6924	23	122	3741	4064
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2489	2250	0	0	3819	3269	0	0	2331	2043
Otros ^c	172	46	703	943	226	46	847	1423	122	23	290	255
Total	218	218	7976	7976	272	272	11617	11616	145	145	6362	6362

^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.