

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 10 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2131 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.30%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	223,9	161,3	125,4	187,3	15,9	16,6	20,0
15-35	525,3	551,7	358,0	344,8	43,2	30,0	150,5
36-60	92,0	29,8	0,0	0,0	29,1	91,3	0,7
61-90	161,5	91,5	0,0	100,0	31,5	1,5	60,0
91-180	201,3	250,8	118,0	127,8	92,8	33,4	40,0
>180	17,6	105,4	27,2	7,0	68,2	0,6	10,0
Total	1221,6	1190,5	628,7	766,9	280,7	173,5	281,2

^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	1.33%	0.86%	1.30%	1.10%
15-35	1.29%	1.16%	0.98%	1.11%
36-60	1.37%	1.69%	1.00%	1.17%
61-90	1.50%	1.85%	1.45%	1.53%
91-180	1.42%	1.73%	1.56%	1.63%
>180	1.70%	2.00%	2.60%	2.02%
Total	1.37%	1.37%	1.20%	1.30%

^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	25	120	2762	2804	47	227	7219	7316	23	122	3813	4172
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1718	1598	0	0	4019	3443	0	0	2418	2097
Otros ^c	120	25	418	495	227	47	955	1434	122	23	297	259
Total	145	145	4898	4897	274	274	12193	12193	145	145	6528	6528

^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.