

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 11 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2134 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.27%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	286,5	377,1	183,9	142,0	179,2	130,5	14,0
15-35	537,0	357,1	282,0	387,2	30,1	104,8	45,0
36-60	93,6	192,4	150,1	17,6	12,2	46,0	30,0
61-90	122,2	100,2	20,7	62,2	20,3	0,8	59,2
91-180	30,5	85,3	39,0	0,0	37,8	22,0	8,5
>180	29,9	101,0	22,2	5,0	56,9	2,9	22,0
Total	1099,8	1213,2	697,9	614,1	336,6	306,9	178,7

^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	1.28%	1.18%	1.11%	1.16%
15-35	1.17%	1.21%	1.08%	1.13%
36-60	1.37%	1.40%	1.15%	1.33%
61-90	1.55%	1.69%	1.53%	1.58%
91-180	1.60%	1.80%	1.42%	1.66%
>180	1.71%	1.92%	1.80%	1.87%
Total	1.42%	1.35%	1.14%	1.27%

^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	23	77	244	349	51	234	7506	7628	21	122	3866	4196
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	198	90	0	0	4143	3605	0	0	2418	2120
Otros ^c	77	23	59	63	234	51	1136	1553	122	21	298	267
Total	100	100	501	502	285	285	12785	12786	143	143	6582	6583

^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.