

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 14 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1479 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.33%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	360,9	252,4	138,6	244,4	52,8	55,4	61
15-35	395,2	448,0	313,7	204,5	20,3	76,7	114
36-60	30,3	28,5	8,0	20,0	20,5	10,3	0
61-90	15,4	26,0	5,1	10,0	20,9	5,4	0
91-180	8,5	26,5	0,0	0,0	26,5	8,5	0
>180	14,7	50,9	30,0	10,0	17,9	1,7	3
Total	825,1	832,3	495,4	488,9	158,9	158,2	178

^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%	1.27%	0.99%	1.19%
15-35	1.40%	1.38%	1.24%	1.32%
36-60	–	1.44%	1.10%	1.35%
61-90	–	1.67%	1.46%	1.59%
91-180	–	1.80%	1.46%	1.72%
>180	2.29%	1.92%	1.65%	1.93%
Total	1.38%	1.44%	1.19%	1.33%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	14 – 18 dic.				21 - 25 dic.				28 dic. - 01 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	56	230	7758	7731	21	119	3920	4290	13	116	2084	2485
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4217	3786	0	0	2439	2149	0	0	1629	1310
Otros ^c	230	56	1147	1605	119	21	344	264	116	13	265	184
Total	286	286	13122	13122	140	140	6703	6703	129	129	3978	3979

^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.