

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 15 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1689 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.47%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	350,4	322,9	145,0	168,3	105,0	109,3	72,9
15-35	582,4	472,9	144,4	228,7	10,5	35,6	318,0
36-60	52,3	30,1	12,3	20,6	17,8	31,6	0,0
61-90	38,4	73,4	61,5	34,6	11,9	3,9	0,0
91-180	0,1	49,5	36,8	0,0	12,6	0,1	0,0
>180	21,3	106,0	51,5	0,0	34,5	1,3	20,0
Total	1045,0	1054,7	451,5	452,2	192,3	181,9	410,9

^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%	1.80%	1.74%	1.69%
15-35	1.29%	1.34%	1.17%	1.27%
36-60	–	1.64%	1.26%	1.36%
61-90	–	1.56%	1.44%	1.53%
91-180	–	1.83%	1.58%	1.83%
>180	1.86%	1.90%	1.64%	1.88%
Total	1.33%	1.64%	1.45%	1.47%

^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	40	210	6011	5983	22	121	4211	4477	14	116	2093	2489
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3061	2533	0	0	2508	2382	0	0	1630	1311
Otros ^c	210	40	978	1534	121	22	408	269	116	14	267	190
Total	250	250	10050	10050	143	143	7127	7128	130	130	3990	3990

^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.