

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 17 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1975 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.35%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	356,7	243,8	110,0	231,2	95,8	87,5	38
15-35	558,5	607,6	433,1	336,0	23,6	71,5	151
36-60	53,0	8,3	0,3	0,0	8,0	53,0	0
61-90	136,8	33,2	0,0	0,0	13,2	116,8	20
91-180	7,4	32,6	20,0	0,0	12,6	7,4	0
>180	50,9	124,9	59,0	20,0	35,9	0,9	30
Total	1163,3	1050,6	622,5	587,2	189,1	337,0	239

^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	1.34%	0.74%	1.78%	1.31%
15-35	1.22%	1.10%	1.13%	1.15%
36-60	–	1.63%	1.18%	1.24%
61-90	1.33%	1.72%	1.40%	1.42%
91-180	–	1.72%	1.46%	1.67%
>180	2.17%	2.17%	2.51%	2.22%
Total	1.37%	1.31%	1.38%	1.35%

^a Incluye solo operaciones interbancarias

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

¹Datos provisionales.

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	24	73	3554	3196	23	122	4552	4689	16	112	2159	2605
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1683	1834	0	0	2613	2686	0	0	1661	1343
Otros ^c	73	24	467	673	122	23	483	273	112	16	341	214
Total	97	97	5704	5703	145	145	7648	7648	128	128	4161	4162

^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.