

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2020**  
**Fecha de Información: 23 de diciembre de 2020<sup>1</sup>**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.51%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	300,7	111,7	57,7	208,2	11,0	49,5	43,0
15-35	339,0	356,8	176,4	159,2	39,4	38,8	141,0
36-60	21,9	42,1	26,6	0,0	12,9	19,4	2,5
61-90	4,4	13,2	0,6	0,0	12,6	4,4	0,0
91-180	13,8	32,7	1,0	0,0	22,2	4,3	9,5
>180	30,2	35,2	15,0	0,0	10,2	20,2	10,0
<b>Total</b>	<b>710,0</b>	<b>591,6</b>	<b>277,3</b>	<b>367,4</b>	<b>108,3</b>	<b>136,6</b>	<b>206,0</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.28%	0.44%	0.22%	0.30%
15-35	0.38%	0.38%	0.22%	0.32%
36-60	0.60%	0.69%	0.29%	0.46%
61-90	–	1.31%	0.94%	1.22%
91-180	1.31%	1.68%	1.27%	1.53%
>180	1.93%	1.98%	1.76%	1.89%
<b>Total</b>	<b>0.48%</b>	<b>0.73%</b>	<b>0.35%</b>	<b>0.51%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones interbancarias

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

<sup>1</sup>Datos provisionales.

<sup>2</sup>El 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	21 – 25 dic.				28 dic. - 01 ene.				04 - 08 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	61	2706	2436	18	133	2597	2875	16	118	3693	3731
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1613	1931	0	0	1814	1632	0	0	2314	1945
Otros <sup>c</sup>	61	35	215	168	133	18	364	269	118	16	372	703
<b>Total</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>4534</b>	<b>4535</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>4775</b>	<b>4776</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>6379</b>	<b>6379</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.