

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 24 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$675 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.27%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	260,3	41,6	36,0	248,0	4,6	11,3	1,0
15-35	164,1	106,7	78,5	129,0	5,4	12,3	22,7
36-60	2,0	6,6	0,0	0,0	6,6	2,0	0,0
61-90	2,2	28,7	15,0	1,1	13,7	1,1	0,0
91-180	11,9	44,4	30,0	0,0	4,4	1,9	10,0
>180	3,3	36,4	35,0	0,0	1,4	3,3	0,0
Total	443,9	264,4	194,5	378,1	36,2	32,0	33,7

^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	0.00%	0.08%	-0.78%	-0.60%
15-35	0.11%	0.17%	0.02%	0.08%
36-60	-	1.09%	-0.44%	0.73%
61-90	-	0.83%	-0.19%	0.79%
91-180	0.88%	1.07%	1.00%	1.03%
>180	-	1.82%	1.50%	1.80%
Total	0.33%	0.81%	-0.25%	0.27%

^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	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 ^a	12	10	350	242	18	129	2644	2891	16	120	3904	3752
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	109	229	0	0	1829	1676	0	0	2334	2150
Otros ^c	10	12	68	55	129	18	364	271	120	16	372	709
Total	22	22	527	526	147	147	4837	4838	136	136	6610	6611

^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.