

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 28 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1050 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.08%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	84,2	78,1	29,0	34,3	22,5	23,2	26,6
15-35	346,4	223,5	150,3	223,0	44,2	94,4	29,0
36-60	1,7	106,6	100,3	0,0	6,3	1,7	0,0
61-90	8,2	12,4	0,2	0,0	12,2	8,2	0,0
91-180	104,7	36,3	20,0	100,0	16,3	4,7	0,0
>180	1,9	102,2	100,0	0,0	2,2	1,9	0,0
Total	547,0	559,0	399,8	357,3	103,6	134,1	55,6

^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	-0.35%	0.00%	-0.18%	-0.17%
15-35	-0.08%	-0.10%	-0.49%	-0.35%
36-60	-	0.87%	0.16%	0.73%
61-90	-	1.06%	0.43%	0.80%
91-180	-	1.10%	0.85%	1.06%
>180	-	1.54%	1.46%	1.54%
Total	-0.21%	0.65%	-0.40%	0.08%

^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	28 dic. - 01 ene.				04 - 08 ene.				11 - 15 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	20	137	2711	2974	16	121	3944	3791	28	136	5290	4608
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1872	1707	0	0	2339	2170	0	0	2709	1891
Otros ^c	137	20	389	291	121	16	385	707	136	28	567	2068
Total	157	157	4972	4972	137	137	6668	6668	164	164	8566	8567

^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.