

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de enero de 2021

Fecha de Información: 30 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1465 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.15%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	298,4	167,9	143,5	231,0	8,3	51,3	16,1
15-35	353,5	473,4	203,2	264,2	195,9	15,1	74,2
36-60	3,3	14,1	0,0	0,0	14,1	3,3	0,0
61-90	50,7	86,2	52,5	40,7	28,6	4,9	5,1
91-180	3,3	38,9	0,0	0,0	38,9	3,3	0,0
>180	8,4	62,4	0,0	7,0	62,4	1,4	0,0
Total	717,5	843,0	399,2	542,9	348,3	79,1	95,5

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario 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	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	-0.05%		-0.11%	0.27%	0.19%
15-35	-0.25%		-0.27%	-0.38%	-0.29%
36-60	–		0.36%	0.03%	0.30%
61-90	0.99%		0.97%	0.37%	0.89%
91-180	–		1.46%	0.98%	1.42%
>180	–		2.44%	2.11%	2.40%
Total	-0.15%		0.25%	0.06%	0.15%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

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

¹ A 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.

² 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	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	6	21	374	324	19	123	4298	3932	34	142	5518	4722
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	140	220	0	0	2470	2389	0	0	2770	2063
Otros ^c	21	6	102	71	123	19	392	839	142	34	571	2055
Total	27	27	616	615	142	142	7160	7160	176	176	8859	8840

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.