

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de enero de 2021
Fecha de Información: 07 de enero de 2021¹

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\$1999 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.48%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	447,5	466,9	272,0	258,9	55,9	49,6	139
15-35	519,8	582,9	429,5	358,5	59,3	67,3	94
36-60	26,2	13,6	0,0	0,0	13,6	26,2	0
61-90	31,1	50,2	18,6	0,0	31,6	31,1	0
91-180	54,6	11,7	0,0	34,1	11,7	20,5	0
>180	15,6	27,5	10,0	0,0	2,5	0,6	15
Total	1094,8	1152,7	730,1	651,5	174,6	195,3	248

^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	1.53%		1.24%	Inf%	1.13%
15-35	1.54%		2.00%	1.34%	1.72%
36-60	—		1.75%	1.20%	1.39%
61-90	—		1.86%	1.37%	1.62%
91-180	—		2.01%	1.82%	1.89%
>180	1.84%		1.96%	1.72%	1.85%
Total	1.55%		1.74%	1.13%	1.48%

^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	04 – 08 ene.				11 - 15 ene.				18 - 22 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	7	60	2962	2796	42	158	6168	5294	25	140	5727	4900
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1752	1596	0	0	2888	2379	0	0	2917	2354
Otros ^c	60	7	296	618	158	42	791	2157	140	25	982	2340
Total	67	67	5010	5010	200	200	9847	9830	165	165	9626	9594

^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.