

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2021
Fecha de Información: 14 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\$2662 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.12%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	352,4	983,9	577,8	244,2	322,6	24,6	83,5
15-35	518,6	480,4	300,6	352,0	28,9	15,7	150,9
36-60	26,8	64,2	50,9	0,0	13,3	26,8	0,0
61-90	278,8	40,8	0,0	0,0	40,8	278,8	0,0
91-180	27,2	29,8	0,0	0,0	29,8	27,2	0,0
>180	77,1	17,5	10,0	0,0	6,5	76,1	1,0
Total	1281,0	1616,6	939,3	596,3	442,0	449,3	235,4

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.10%	0.74%	1.08%	0.85%
15-35	1.30%	1.26%	1.36%	1.32%
36-60	—	1.95%	1.31%	1.53%
61-90	—	1.77%	1.29%	1.35%
91-180	—	1.92%	1.60%	1.77%
>180	1.60%	2.19%	1.67%	1.71%
Total	1.23%	0.92%	1.29%	1.12%

^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	11 – 15 ene.				18 - 22 ene.				25 - 29 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	27	111	4633	4667	32	140	6156	5895	20	219	3119	2779
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2345	1549	0	0	3687	2587	0	0	1660	1142
Otros ^c	111	27	880	1640	140	32	1085	2414	219	20	554	1412
Total	138	138	7858	7856	172	172	10928	10896	239	239	5333	5333

^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.