

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2021
Fecha de Información: 18 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\$1004 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.27%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	185,3	160,6	58,0	79,2	7,6	11,1	95
15-35	668,6	666,2	63,7	69,0	5,5	2,6	597
36-60	2,8	3,7	0,0	1,7	3,7	1,1	0
61-90	3,1	0,9	0,0	0,0	0,9	3,1	0
91-180	2,1	1,2	0,0	0,0	1,2	2,1	0
>180	1,2	0,4	0,0	0,0	0,4	1,2	0
Total	863,1	833,0	121,7	149,9	19,3	21,2	692

^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	0.75%	0.99%	1.13%	0.90%
15-35	1.36%	1.47%	1.22%	1.36%
36-60	—	1.94%	0.90%	1.70%
61-90	—	1.80%	1.28%	1.39%
91-180	—	2.30%	1.09%	1.53%
>180	—	2.22%	1.26%	1.50%
Total	1.28%	1.27%	1.17%	1.27%

^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	18 – 22 ene.				25 - 29 ene.				01 - 05 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	29	141	6295	6573	21	237	3216	2976	6	80	2742	2684
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4211	2638	0	0	1796	1173	0	0	1717	1558
Otros ^c	141	29	1174	2437	237	21	564	1428	80	6	295	505
Total	170	170	11680	11648	258	258	5576	5577	86	86	4754	4747

^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.