

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de enero de 2021**  
**Fecha de Información: 18 de enero de 2021<sup>1</sup>**

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%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
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
<b>Total</b>	<b>863,1</b>	<b>833,0</b>	<b>121,7</b>	<b>149,9</b>	<b>19,3</b>	<b>21,2</b>	<b>692</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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%
<b>Total</b>	<b>1.28%</b>		<b>1.27%</b>	<b>1.17%</b>	<b>1.27%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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 <sup>a</sup>	29	141	6295	6573	21	237	3216	2976	6	80	2742	2684
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4211	2638	0	0	1796	1173	0	0	1717	1558
Otros <sup>c</sup>	141	29	1174	2437	237	21	564	1428	80	6	295	505
<b>Total</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>11680</b>	<b>11648</b>	<b>258</b>	<b>258</b>	<b>5576</b>	<b>5577</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>4754</b>	<b>4747</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.