

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2021
Fecha de Información: 19 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\$2379 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.18%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 | 437,8 | 475,4 | 361,6 | 252,9 | 14,9 | 86,1 | 98,9 |
| 15-35 | 528,7 | 545,1 | 338,5 | 315,3 | 89,6 | 96,4 | 117,0 |
| 36-60 | 80,1 | 61,3 | 52,2 | 53,0 | 9,1 | 27,1 | 0,0 |
| 61-90 | 22,9 | 133,3 | 110,0 | 10,0 | 20,8 | 10,4 | 2,5 |
| 91-180 | 77,3 | 98,2 | 35,0 | 18,2 | 28,2 | 24,1 | 35,0 |
| >180 | 119,5 | 52,9 | 50,6 | 95,7 | 2,3 | 23,7 | 0,0 |
| Total | 1266,4 | 1366,1 | 947,9 | 745,1 | 164,8 | 267,9 | 253,4 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 1.05% | | 0.91% | 0.87% | 0.91% |
| 15-35 | 1.35% | | 1.36% | 1.21% | 1.31% |
| 36-60 | — | | 1.30% | 1.30% | 1.30% |
| 61-90 | 1.56% | | 1.54% | 1.22% | 1.50% |
| 91-180 | 1.55% | | 1.80% | 1.36% | 1.58% |
| >180 | — | | 2.06% | 1.71% | 1.72% |
| Total | 1.26% | | 1.22% | 1.11% | 1.18% |

^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.

¹A 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.

²El 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 ^a | 31 | 143 | 6686 | 6913 | 22 | 237 | 3328 | 3119 | 29 | 80 | 2772 | 2814 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4507 | 2931 | 0 | 0 | 1875 | 1203 | 0 | 0 | 1777 | 1568 |
| Otros ^c | 143 | 31 | 1172 | 2490 | 235 | 22 | 577 | 1457 | 80 | 29 | 350 | 509 |
| Total | 174 | 174 | 12365 | 12334 | 257 | 259 | 5780 | 5779 | 109 | 109 | 4899 | 4891 |

^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.