

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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	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.