

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2021
Fecha de Información: 20 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\$1577 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.17%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	347,8	143,8	95,8	263,0	11,1	47,9	36,9
15-35	342,3	555,0	452,9	261,3	73,1	52,0	29,0
36-60	50,7	14,3	0,0	0,0	14,3	50,7	0,0
61-90	34,2	74,2	42,0	0,0	27,2	29,2	5,0
91-180	24,8	38,2	25,0	0,0	7,2	18,8	6,0
>180	3,2	28,0	20,0	0,0	5,0	0,2	3,0
Total	802,9	853,5	635,7	524,3	138,0	198,7	79,9

^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%		1.03%	0.91%	0.95%
15-35	1.29%		1.23%	1.13%	1.20%
36-60	—		1.59%	1.28%	1.35%
61-90	1.38%		1.57%	1.22%	1.38%
91-180	1.54%		1.93%	1.40%	1.55%
>180	1.81%		1.82%	1.71%	1.82%
Total	1.22%		1.28%	1.07%	1.17%

^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	16	113	4521	4344	24	237	3370	3210	29	79	2833	2971
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2797	2049	0	0	1948	1228	0	0	1907	1600
Otros ^c	113	16	629	1524	235	24	583	1462	79	29	357	519
Total	129	129	7947	7917	259	261	5901	5900	108	108	5097	5090

^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.