

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de enero de 2021**  
**Fecha de Información: 20 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\$1577 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.17%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		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
<b>Total</b>	<b>802,9</b>	<b>853,5</b>	<b>635,7</b>	<b>524,3</b>	<b>138,0</b>	<b>198,7</b>	<b>79,9</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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%
<b>Total</b>	<b>1.22%</b>	<b>1.28%</b>	<b>1.07%</b>	<b>1.17%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	16	113	4521	4344	24	237	3370	3210	29	79	2833	2971
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2797	2049	0	0	1948	1228	0	0	1907	1600
Otros <sup>c</sup>	113	16	629	1524	235	24	583	1462	79	29	357	519
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>7947</b>	<b>7917</b>	<b>259</b>	<b>261</b>	<b>5901</b>	<b>5900</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>5097</b>	<b>5090</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.