

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2021
Fecha de Información: 21 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\$2157 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.21%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	297,2	424,0	280,6	92,0	16,4	78,2	127,0
15-35	564,1	628,2	374,5	338,1	80,9	53,2	172,8
36-60	31,2	11,7	0,0	0,1	1,7	21,1	10,0
61-90	81,4	89,2	43,4	0,7	45,8	80,7	0,0
91-180	122,2	193,5	110,0	0,0	8,5	47,2	75,0
>180	21,6	77,2	70,0	20,0	7,2	1,6	0,0
Total	1117,7	1423,8	878,5	450,9	160,4	282,0	384,8

^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	1.15%		1.18%	0.75%	1.05%
15-35	1.18%		1.18%	1.17%	1.17%
36-60	1.17%		1.74%	1.08%	1.14%
61-90	-		1.50%	1.28%	1.36%
91-180	1.43%		1.41%	1.27%	1.39%
>180	-		2.01%	1.66%	2.00%
Total	1.22%		1.30%	1.09%	1.21%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})} - 1)$. 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	11	81	2609	2465	23	236	3516	3394	31	79	2918	3140
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1687	1408	0	0	2082	1299	0	0	1972	1605
Otros ^c	81	11	294	707	235	23	594	1499	79	31	392	518
Total	92	92	4590	4580	258	259	6192	6192	110	110	5282	5263

^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.