

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de enero de 2021**  
**Fecha de Información: 22 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\$1720 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.31%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	250,3	417,6	343,8	172,4	45,8	49,9	28,0
15-35	437,2	494,3	379,8	289,0	2,7	36,4	111,8
36-60	16,6	3,2	1,6	0,0	1,6	16,6	0,0
61-90	102,6	131,3	74,0	10,0	1,3	36,6	56,0
91-180	3,3	3,4	0,0	0,0	3,0	2,9	0,4
>180	54,3	12,1	0,0	30,0	2,1	14,3	10,0
<b>Total</b>	<b>864,3</b>	<b>1061,9</b>	<b>799,2</b>	<b>501,4</b>	<b>56,5</b>	<b>156,7</b>	<b>206,2</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	1.53%	1.29%	1.21%	1.27%
15-35	1.36%	1.34%	1.26%	1.32%
36-60	—	1.56%	1.23%	1.28%
61-90	1.48%	1.79%	1.27%	1.40%
91-180	1.39%	1.80%	1.20%	1.49%
>180	1.55%	2.05%	1.37%	1.49%
<b>Total</b>	<b>1.42%</b>	<b>1.32%</b>	<b>1.24%</b>	<b>1.31%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$ . 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>	10	23	375	396	26	249	3720	3616	31	78	2974	3318
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	306	221	0	0	2257	1424	0	0	2107	1650
Otros <sup>c</sup>	23	10	72	136	247	26	604	1540	78	31	429	524
<b>Total</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>753</b>	<b>753</b>	<b>273</b>	<b>275</b>	<b>6581</b>	<b>6580</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>5510</b>	<b>5492</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.