

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2021
Fecha de Información: 22 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\$1720 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.31%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	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
Total	864,3	1061,9	799,2	501,4	56,5	156,7	206,2

^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	1.53%		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%
Total	1.42%		1.32%	1.24%	1.31%

^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.

¹ 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.

² 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	10	23	375	396	26	249	3720	3616	31	78	2974	3318
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	306	221	0	0	2257	1424	0	0	2107	1650
Otros ^c	23	10	72	136	247	26	604	1540	78	31	429	524
Total	33	33	753	753	273	275	6581	6580	109	109	5510	5492

^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.