

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2021
Fecha de Información: 25 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\$1945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.44%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	156,0	225,4	65,2	58,0	111,7	49,5	48,5
15-35	555,0	510,2	409,3	207,7	40,1	286,5	60,8
36-60	211,6	33,5	20,0	0,6	6,5	204,0	7,0
61-90	139,2	190,1	120,4	0,0	31,6	101,2	38,0
91-180	13,0	13,7	4,2	0,3	9,5	12,8	0,0
>180	18,6	33,4	30,0	5,0	3,4	13,6	0,0
Total	1093,5	1006,2	649,2	271,5	202,8	667,7	154,3

^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	1.46%	1.48%	1.04%	1.34%
15-35	1.43%	1.62%	1.38%	1.48%
36-60	1.47%	1.55%	1.41%	1.42%
61-90	1.45%	1.53%	1.33%	1.45%
91-180	—	1.66%	1.33%	1.47%
>180	—	1.80%	1.45%	1.52%
Total	1.45%	1.56%	1.35%	1.44%

^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	25 – 29 ene.				01 - 05 feb.				08 - 12 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	28	260	3936	3906	32	78	3045	3428	21	92	3103	3134
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2355	1587	0	0	2166	1672	0	0	1972	1293
Otros ^c	259	28	794	1592	78	32	447	539	92	21	324	963
Total	287	288	7085	7085	110	110	5658	5639	113	113	5399	5390

^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.