

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2021
Fecha de Información: 26 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\$1619 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.24%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	275,2	192,0	138,5	206,2	10,3	25,8	43,2
15-35	312,4	474,6	442,1	244,5	12,5	47,9	20,0
36-60	135,1	76,6	54,5	0,0	16,8	129,8	5,3
61-90	21,4	140,5	134,0	0,0	4,7	19,7	1,8
91-180	23,8	9,4	0,0	0,0	9,0	23,4	0,4
>180	21,4	13,2	1,3	0,0	6,0	15,4	6,0
Total	789,4	906,3	770,4	450,7	59,3	262,0	76,7

^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	1.27%		1.11%	0.69%	0.89%
15-35	1.35%		1.37%	1.34%	1.36%
36-60	1.40%		1.46%	1.32%	1.37%
61-90	1.31%		1.36%	1.21%	1.34%
91-180	1.44%		1.75%	1.37%	1.47%
>180	1.74%		1.80%	1.58%	1.67%
Total	1.34%		1.34%	1.12%	1.24%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	23	225	3349	3366	33	87	3157	3535	21	92	3115	3170
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2061	1487	0	0	2244	1753	0	0	2007	1301
Otros ^c	224	23	724	1281	87	33	448	542	92	21	325	967
Total	247	248	6134	6134	120	120	5849	5830	113	113	5447	5438

^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.