

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de enero de 2021**  
**Fecha de Información: 26 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\$1619 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.24%<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	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
<b>Total</b>	<b>789,4</b>	<b>906,3</b>	<b>770,4</b>	<b>450,7</b>	<b>59,3</b>	<b>262,0</b>	<b>76,7</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	1.27%	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%
<b>Total</b>	<b>1.34%</b>	<b>1.34%</b>	<b>1.12%</b>	<b>1.24%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$ . 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 <sup>a</sup>	23	225	3349	3366	33	87	3157	3535	21	92	3115	3170
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2061	1487	0	0	2244	1753	0	0	2007	1301
Otros <sup>c</sup>	224	23	724	1281	87	33	448	542	92	21	325	967
<b>Total</b>	<b>247</b>	<b>248</b>	<b>6134</b>	<b>6134</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5849</b>	<b>5830</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5447</b>	<b>5438</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.