

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2021
Fecha de Información: 27 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\$2289 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.30%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	378,6	262,9	182,6	273,0	10,9	36,2	69,4
15-35	614,2	920,1	584,1	214,2	13,9	78,0	322,0
36-60	92,7	24,8	6,0	0,0	18,8	92,7	0,0
61-90	160,8	158,3	10,0	10,0	13,3	15,8	135,0
91-180	44,6	121,3	96,0	0,0	10,3	29,6	15,0
>180	49,0	33,2	0,5	6,9	2,4	11,8	30,3
Total	1339,8	1520,7	879,3	504,1	69,7	264,0	571,7

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.34%	1.09%	0.95%	1.04%
15-35	1.38%	1.35%	1.32%	1.36%
36-60	—	1.66%	1.26%	1.35%
61-90	1.44%	1.55%	1.23%	1.44%
91-180	1.39%	1.37%	1.29%	1.35%
>180	1.64%	1.83%	1.49%	1.59%
Total	1.40%	1.34%	1.16%	1.30%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	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	19	191	2714	2721	36	86	3245	3579	24	96	3256	3382
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1637	1148	0	0	2287	1837	0	0	2191	1394
Otros ^c	189	19	616	1099	86	36	448	546	96	24	328	990
Total	208	210	4967	4968	122	122	5980	5962	120	120	5775	5766

^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.