

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de febrero de 2021
Fecha de Información: 28 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\$2456 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.25%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	282,0	341,2	198,0	140,1	12,2	10,9	131,0
15-35	1254,2	1094,1	201,8	338,5	44,4	67,7	848,0
36-60	54,3	95,9	10,7	0,0	85,2	54,3	0,0
61-90	23,7	27,0	0,2	0,0	13,7	10,5	13,1
91-180	52,5	189,9	140,0	0,0	24,9	27,5	25,0
>180	53,6	39,3	0,0	11,0	4,3	7,6	35,0
Total	1720,3	1787,5	550,7	489,6	184,7	178,5	1052,1

^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	1.21%	0.78%	0.83%	1.01%
15-35	1.31%	1.36%	1.12%	1.28%
36-60	—	1.26%	1.21%	1.24%
61-90	1.25%	1.54%	1.06%	1.30%
91-180	1.31%	1.32%	1.23%	1.31%
>180	1.71%	1.84%	1.18%	1.63%
Total	1.31%	1.25%	1.09%	1.25%

^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	17	159	1128	1132	37	87	3387	3733	24	98	3311	3412
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	482	264	0	0	2334	1869	0	0	2193	1419
Otros ^c	157	17	419	632	87	37	449	550	98	24	329	993
Total	174	176	2029	2028	124	124	6170	6152	122	122	5833	5824

^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.