

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de febrero de 2021
Fecha de Información: 29 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\$1082 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.21%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	164,2	134,8	38,3	64,7	14,2	17,1	82,4
15-35	255,8	492,1	307,0	79,7	53,0	44,0	132,0
36-60	48,3	26,8	0,0	26,0	11,8	7,3	15,0
61-90	96,3	81,5	13,1	0,0	23,3	51,3	45,0
91-180	2,7	12,6	0,0	0,0	12,6	2,7	0,0
>180	34,4	28,0	0,0	10,0	7,5	3,9	20,5
Total	601,5	775,8	358,5	180,4	122,4	126,2	294,9

^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	1.21%		1.11%	1.06%	1.13%
15-35	1.17%		1.21%	1.16%	1.19%
36-60	1.28%		1.37%	1.16%	1.27%
61-90	1.39%		1.49%	1.01%	1.26%
91-180	—		1.46%	1.27%	1.43%
>180	1.59%		1.98%	0.69%	1.57%
Total	1.25%		1.25%	1.08%	1.21%

^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	6	123	536	590	38	97	3519	3832	25	98	3417	3528
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	255	206	0	0	2379	1941	0	0	2268	1486
Otros ^c	123	6	213	208	97	38	452	559	98	25	334	997
Total	129	129	1004	1004	135	135	6350	6332	123	123	6019	6011

^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.