

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 01 de febrero 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\$1294 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.07%<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	308,1	340,1	264,7	221,0	5,4	17,1	70,0
15-35	242,7	263,2	193,2	117,9	13,0	67,8	57,0
36-60	33,2	26,5	24,4	0,0	1,7	32,7	0,5
61-90	60,4	54,3	20,0	0,0	9,3	35,4	25,0
91-180	38,6	8,7	0,0	0,0	8,7	38,6	0,0
>180	29,8	40,6	36,3	26,3	4,3	3,5	0,0
<b>Total</b>	<b>712,9</b>	<b>733,4</b>	<b>538,6</b>	<b>365,2</b>	<b>42,3</b>	<b>195,2</b>	<b>152,5</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.05%		0.89%	0.82%	0.88%
15-35	1.21%		1.22%	1.09%	1.15%
36-60	1.00%		1.37%	1.20%	1.25%
61-90	1.38%		1.49%	1.15%	1.32%
91-180	—		1.93%	1.30%	1.42%
>180	—		2.64%	1.45%	2.10%
<b>Total</b>	<b>1.16%</b>		<b>1.10%</b>	<b>1.01%</b>	<b>1.07%</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	01 – 05 feb.				08 - 12 feb.				15 - 19 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	43	102	3662	3885	28	99	3537	3696	21	140	5094	4451
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2457	2034	0	0	2408	1575	0	0	2361	1558
Otros <sup>c</sup>	102	43	389	571	99	28	335	1000	140	21	570	2010
<b>Total</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>6508</b>	<b>6490</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6280</b>	<b>6271</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>8025</b>	<b>8019</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.