

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de febrero de 2021
Fecha de Información: 01 de febrero 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\$1294 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.07%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		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
Total	712,9	733,4	538,6	365,2	42,3	195,2	152,5

^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	1.05%	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%
Total	1.16%	1.10%	1.01%	1.07%

^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	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 ^a	43	102	3662	3885	28	99	3537	3696	21	140	5094	4451
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2457	2034	0	0	2408	1575	0	0	2361	1558
Otros ^c	102	43	389	571	99	28	335	1000	140	21	570	2010
Total	145	145	6508	6490	127	127	6280	6271	161	161	8025	8019

^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.