

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 02 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\$2121 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.12%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	557,7	512,2	260,4	303,6	13,3	15,6	238,5
15-35	529,4	466,7	262,2	293,6	30,0	61,3	174,5
36-60	151,0	225,9	99,9	0,0	16,0	40,9	110,0
61-90	53,7	133,6	75,0	0,0	11,0	6,1	47,6
91-180	5,8	28,9	0,0	0,0	28,3	5,2	0,6
>180	13,1	15,9	11,1	0,0	2,8	11,1	2,0
<b>Total</b>	<b>1310,8</b>	<b>1383,1</b>	<b>708,6</b>	<b>597,2</b>	<b>101,3</b>	<b>140,4</b>	<b>573,2</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.12%	0.90%	0.89%	0.98%
15-35	1.20%	1.15%	1.04%	1.12%
36-60	1.22%	1.37%	1.01%	1.22%
61-90	1.39%	1.44%	1.28%	1.41%
91-180	1.15%	1.54%	1.47%	1.52%
>180	1.79%	1.67%	1.66%	1.67%
<b>Total</b>	<b>1.19%</b>	<b>1.18%</b>	<b>1.00%</b>	<b>1.12%</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>	38	79	3333	3527	28	101	3890	3966	21	143	5151	4583
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2187	1955	0	0	2479	1731	0	0	2435	1559
Otros <sup>c</sup>	79	38	383	410	101	28	336	1000	143	21	575	2012
<b>Total</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>5903</b>	<b>5892</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>6705</b>	<b>6697</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>8161</b>	<b>8154</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.