

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 03 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\$2080 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.05%<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         | 417,2                          | 508,6         | 166,8                               | 45         | 80,5          | 110,8        | 261,4                                |
| 15-35        | 866,3                          | 646,1         | 156,5                               | 251        | 23,6          | 149,3        | 466,0                                |
| 36-60        | 142,1                          | 140,0         | 18,7                                | 30         | 16,2          | 6,9          | 105,2                                |
| 61-90        | 60,7                           | 84,4          | 52,8                                | 35         | 16,6          | 10,7         | 15,0                                 |
| 91-180       | 1,6                            | 19,4          | 0,0                                 | 0          | 19,4          | 1,6          | 0,0                                  |
| >180         | 25,9                           | 34,8          | 13,0                                | 0          | 1,8           | 5,9          | 20,0                                 |
| <b>Total</b> | <b>1513,7</b>                  | <b>1433,4</b> | <b>407,7</b>                        | <b>361</b> | <b>158,1</b>  | <b>285,2</b> | <b>867,5</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 |              | Total        |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas                                    | Compras                      | Ventas       |              |
| 3-14         | 1.03%   | 1.00%                        | 0.70%        | 0.94%        |
| 15-35        | 1.00%   | 1.08%                        | 0.99%        | 1.01%        |
| 36-60        | 1.25%   | 1.27%                        | 1.08%        | 1.24%        |
| 61-90        | 1.37%   | 1.50%                        | 1.20%        | 1.45%        |
| 91-180       | —   | 1.61%                        | 1.21%        | 1.58%        |
| >180         | 1.53%   | 1.84%                        | 1.39%        | 1.62%        |
| <b>Total</b> | <b>1.06%</b>                                      | <b>1.18%</b>                 | <b>0.91%</b> | <b>1.05%</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>      | 17           | 64        | 2744        | 2947        | 45           | 100        | 3979        | 4107        | 21           | 143        | 5294        | 4682        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0         | 1732        | 1426        | 0            | 0          | 2479        | 1753        | 0            | 0          | 2464        | 1603        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 64           | 17        | 342         | 435         | 100          | 45         | 411         | 1001        | 143          | 21         | 575         | 2040        |
| <b>Total</b>                        | <b>81</b>    | <b>81</b> | <b>4818</b> | <b>4808</b> | <b>145</b>   | <b>145</b> | <b>6869</b> | <b>6861</b> | <b>164</b>   | <b>164</b> | <b>8333</b> | <b>8325</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.