

# 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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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.