

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de enero de 2021**

**Fecha de Información: 29 de diciembre de 2020<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\$1926 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0.28%<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	309,0	139,9	96,0	180,1	4,0	89,0	39,9
15-35	659,0	686,4	397,0	441,1	105,6	34,1	183,8
36-60	2,0	102,1	78,5	0,0	23,5	2,0	0,0
61-90	11,3	48,5	37,0	0,0	6,5	6,3	5,0
91-180	123,5	44,6	5,0	100,0	19,2	3,0	20,5
>180	24,2	24,7	15,0	10,0	9,7	14,2	0,0
<b>Total</b>	<b>1128,9</b>	<b>1046,2</b>	<b>628,5</b>	<b>731,2</b>	<b>168,5</b>	<b>148,6</b>	<b>249,2</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	-0.51%		1.29%	-0.53%	-0.26%
15-35	-0.57%		-0.40%	-0.59%	-0.51%
36-60	-		0.28%	-0.35%	0.23%
61-90	0.25%		0.80%	0.22%	0.44%
91-180	0.68%		1.18%	0.84%	0.94%
>180	-		1.99%	1.72%	1.79%
<b>Total</b>	<b>-0.44%</b>		<b>-0.01%</b>	<b>-0.42%</b>	<b>-0.28%</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	28 dic. - 01 ene.				04 - 08 ene.				11 - 15 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	17	88	2182	2214	19	121	4157	3823	34	139	5381	4717
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1375	1390	0	0	2372	2304	0	0	2770	1928
Otros <sup>c</sup>	88	17	283	234	121	19	387	789	139	34	565	2054
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>3840</b>	<b>3838</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>6916</b>	<b>6916</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>8716</b>	<b>8699</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.