

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de enero de 2021**

**Fecha de Información: 30 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\$1465 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.15%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	298,4	167,9	143,5	231,0	8,3	51,3	16,1
15-35	353,5	473,4	203,2	264,2	195,9	15,1	74,2
36-60	3,3	14,1	0,0	0,0	14,1	3,3	0,0
61-90	50,7	86,2	52,5	40,7	28,6	4,9	5,1
91-180	3,3	38,9	0,0	0,0	38,9	3,3	0,0
>180	8,4	62,4	0,0	7,0	62,4	1,4	0,0
<b>Total</b>	<b>717,5</b>	<b>843,0</b>	<b>399,2</b>	<b>542,9</b>	<b>348,3</b>	<b>79,1</b>	<b>95,5</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	-0.05%		-0.11%	0.27%	0.19%
15-35	-0.25%		-0.27%	-0.38%	-0.29%
36-60	-		0.36%	0.03%	0.30%
61-90	0.99%		0.97%	0.37%	0.89%
91-180	-		1.46%	0.98%	1.42%
>180	-		2.44%	2.11%	2.40%
<b>Total</b>	<b>-0.15%</b>		<b>0.25%</b>	<b>0.06%</b>	<b>0.15%</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>	6	21	374	324	19	123	4298	3932	34	142	5518	4722
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	140	220	0	0	2470	2389	0	0	2770	2063
Otros <sup>c</sup>	21	6	102	71	123	19	392	839	142	34	571	2055
<b>Total</b>	<b>27</b>	<b>27</b>	<b>616</b>	<b>615</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>7160</b>	<b>7160</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>8859</b>	<b>8840</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.