

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de enero de 2021
Fecha de Información: 04 de enero de 2021¹

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\$1940 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.81%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	181,0	251,3	224,2	142,2	25,4	37,2	1,6
15-35	714,9	568,0	483,5	533,5	14,5	111,4	70,0
36-60	29,5	7,2	0,0	22,5	7,2	7,0	0,0
61-90	20,7	99,0	60,0	0,0	19,0	0,7	20,0
91-180	66,1	25,1	0,0	60,0	20,1	1,1	5,0
>180	60,6	27,7	0,0	35,0	12,7	10,6	15,0
Total	1072,8	978,3	767,7	793,2	99,0	168,0	111,6

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c 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 ^a		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	-1.50%		0.51%	0.33%	0.44%
15-35	0.69%		0.67%	0.63%	0.65%
36-60	-		1.49%	0.73%	0.98%
61-90	1.34%		1.43%	0.70%	1.40%
91-180	1.99%		1.62%	1.79%	1.76%
>180	2.08%		2.07%	2.00%	2.03%
Total	1.02%		0.78%	0.81%	0.81%

^a 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.

¹A 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.

²El 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	04 – 08 ene.				11 - 15 ene.				18 - 22 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	20	127	4428	4205	44	145	5627	4744	21	139	5410	4416
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2705	2484	0	0	2772	2148	0	0	2668	2278
Otros ^c	127	20	399	844	145	44	589	2078	139	21	960	2313
Total	147	147	7532	7533	189	189	8988	8970	160	160	9038	9007

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.