

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de enero de 2021
Fecha de Información: 05 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\$2131 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.39%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	299,2	356,3	110,5	160,5	138,7	31,6	107,1
15-35	616,6	447,9	168,2	332,2	24,7	29,4	255,0
36-60	19,7	8,2	0,0	0,0	3,2	14,7	5,0
61-90	114,8	78,0	61,0	0,0	11,9	109,8	5,0
91-180	105,4	216,8	185,8	70,4	16,0	20,1	15,0
>180	100,9	159,6	150,0	87,2	4,6	8,7	5,0
Total	1256,6	1266,8	675,6	650,2	199,2	214,2	392,1

^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	1.41%		0.96%	1.17%	1.12%
15-35	1.40%		1.39%	1.25%	1.35%
36-60	1.44%		1.75%	1.10%	1.26%
61-90	1.45%		1.68%	1.50%	1.51%
91-180	1.92%		1.94%	1.95%	1.94%
>180	2.00%		2.01%	2.28%	2.05%
Total	1.43%		1.40%	1.34%	1.39%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	12	99	3957	3901	44	143	5708	4903	21	140	5465	4443
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2432	2195	0	0	2856	2183	0	0	2677	2303
Otros ^c	99	12	463	756	143	44	619	2080	140	21	964	2328
Total	111	111	6852	6852	187	187	9183	9166	161	161	9106	9074

^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.