

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de enero de 2021
Fecha de Información: 06 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\$1590 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.54%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	424,9	406,2	76,5	155,2	169,7	109,7	160,0
15-35	391,8	347,4	247,9	201,5	6,0	96,8	93,5
36-60	30,4	33,2	0,5	0,0	12,8	10,4	20,0
61-90	54,2	34,0	10,0	0,0	14,0	44,2	10,0
91-180	1,7	39,5	0,0	0,0	39,5	1,7	0,0
>180	18,0	100,0	70,0	10,0	22,0	0,0	8,0
Total	921,0	960,4	404,8	366,7	264,1	262,8	291,5

^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	1.44%		1.56%	1.30%	1.43%
15-35	1.67%		1.60%	1.36%	1.51%
36-60	1.50%		1.68%	1.12%	1.46%
61-90	1.55%		1.72%	1.43%	1.53%
91-180	-		1.90%	1.17%	1.87%
>180	2.05%		2.20%	2.34%	2.21%
Total	1.54%		1.70%	1.36%	1.54%

^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	10	83	3538	3412	44	144	5933	5143	21	140	5583	4630
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2053	1852	0	0	2856	2240	0	0	2762	2332
Otros ^c	83	10	435	761	144	44	753	2142	140	21	981	2332
Total	93	93	6026	6025	188	188	9542	9525	161	161	9326	9294

^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.