

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2021
Fecha de Información: 08 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\$1876 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.51%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	411,7	540,4	301	194,2	67,4	45,6	172,0
15-35	495,0	432,6	226	275,5	20,5	33,5	186,1
36-60	70,5	14,4	0	0,0	14,4	70,5	0,0
61-90	51,6	99,6	50	5,0	3,5	0,5	46,2
91-180	22,8	33,4	0	0,0	13,4	2,8	20,0
>180	36,1	117,2	87	10,0	5,2	1,1	25,0
Total	1087,9	1237,7	664	484,7	124,5	154,0	449,2

^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	1.86%		1.48%	0.16%	1.45%
15-35	1.54%		1.54%	1.41%	1.50%
36-60	-		2.17%	1.47%	1.59%
61-90	1.55%		2.24%	1.38%	1.60%
91-180	1.69%		1.96%	1.45%	1.77%
>180	1.79%		1.96%	1.96%	1.86%
Total	1.68%		1.56%	1.24%	1.51%

^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	2	24	702	655	44	169	6502	5668	27	140	5804	5053
Intragrupo y off-shore ^b	0	1	378	234	0	0	3053	2540	0	0	3054	2401
Otros ^c	24	1	132	323	169	44	855	2185	140	27	984	2355
Total	26	26	1212	1212	213	213	10410	10393	167	167	9842	9809

^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.