

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de enero de 2021**  
**Fecha de Información: 12 de enero de 2021<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\$2118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.21%<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	480,2	505,8	304,0	224,1	67,0	121,2	134,8
15-35	416,2	565,2	426,6	212,5	16,5	81,7	122,0
36-60	117,2	59,9	50,1	85,0	9,9	32,2	0,0
61-90	60,0	149,6	56,2	2,5	38,4	2,5	55,0
91-180	5,6	15,6	0,0	0,0	15,4	5,4	0,2
>180	10,0	54,7	40,0	0,0	4,7	0,0	10,0
<b>Total</b>	<b>1089,3</b>	<b>1350,9</b>	<b>876,9</b>	<b>524,1</b>	<b>152,0</b>	<b>243,1</b>	<b>322,0</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	1.19%		1.44%	0.57%	1.01%
15-35	1.33%		1.53%	0.97%	1.30%
36-60	-		1.59%	1.35%	1.39%
61-90	1.67%		1.60%	1.28%	1.63%
91-180	1.35%		1.93%	1.70%	1.86%
>180	1.79%		2.14%	1.01%	1.90%
<b>Total</b>	<b>1.34%</b>		<b>1.51%</b>	<b>0.81%</b>	<b>1.21%</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	11 – 15 ene.				18 - 22 ene.				25 - 29 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	42	172	6832	5932	32	140	5979	5403	17	211	2753	2521
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3261	2669	0	0	3324	2509	0	0	1464	862
Otros <sup>c</sup>	172	42	859	2333	140	32	1041	2399	211	17	541	1376
<b>Total</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>10952</b>	<b>10934</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>10344</b>	<b>10311</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>4758</b>	<b>4759</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.