

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2021
Fecha de Información: 13 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\$2057 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.37%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	479,4	631,7	413,0	227,3	45,8	79,1	172,9
15-35	393,6	392,8	257,5	246,2	0,0	0,0	147,4
36-60	143,3	11,2	0,4	94,0	10,8	49,3	0,0
61-90	56,7	34,4	0,2	36,6	29,7	15,6	4,5
91-180	10,9	20,7	0,0	0,0	20,7	10,9	0,0
>180	118,4	109,6	85,0	85,0	3,6	12,4	21,0
Total	1202,3	1200,4	756,1	689,1	110,6	167,3	345,8

^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	1.63%		1.23%	0.89%	1.20%
15-35	1.41%		1.58%	1.50%	1.51%
36-60	-		1.80%	1.34%	1.37%
61-90	1.45%		1.76%	1.52%	1.63%
91-180	-		1.99%	1.66%	1.88%
>180	1.80%		2.27%	1.85%	1.86%
Total	1.56%		1.42%	1.23%	1.37%

^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	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 ^a	35	155	5536	4959	32	141	6098	5727	19	211	2987	2565
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2646	2055	0	0	3526	2534	0	0	1476	1057
Otros ^c	155	35	711	1860	141	32	1078	2408	211	19	553	1394
Total	190	190	8893	8874	173	173	10702	10669	230	230	5016	5016

^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.