

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de febrero de 2021
Fecha de Información: 02 de febrero 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\$2121 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.12%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	557,7	512,2	260,4	303,6	13,3	15,6	238,5
15-35	529,4	466,7	262,2	293,6	30,0	61,3	174,5
36-60	151,0	225,9	99,9	0,0	16,0	40,9	110,0
61-90	53,7	133,6	75,0	0,0	11,0	6,1	47,6
91-180	5,8	28,9	0,0	0,0	28,3	5,2	0,6
>180	13,1	15,9	11,1	0,0	2,8	11,1	2,0
Total	1310,8	1383,1	708,6	597,2	101,3	140,4	573,2

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.12%		0.90%	0.89%	0.98%
15-35	1.20%		1.15%	1.04%	1.12%
36-60	1.22%		1.37%	1.01%	1.22%
61-90	1.39%		1.44%	1.28%	1.41%
91-180	1.15%		1.54%	1.47%	1.52%
>180	1.79%		1.67%	1.66%	1.67%
Total	1.19%		1.18%	1.00%	1.12%

^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	01 – 05 feb.				08 - 12 feb.				15 - 19 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	38	79	3333	3527	28	101	3890	3966	21	143	5151	4583
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2187	1955	0	0	2479	1731	0	0	2435	1559
Otros ^c	79	38	383	410	101	28	336	1000	143	21	575	2012
Total	117	117	5903	5892	129	129	6705	6697	164	164	8161	8154

^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.