

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de febrero de 2021
Fecha de Información: 05 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\$2056 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.22%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	574,1	632,7	288,6	213,2	84,6	101,3	259,5
15-35	527,8	547,6	234,3	199,9	16,2	30,8	297,1
36-60	14,0	5,9	0,0	10,0	5,9	4,0	0,0
61-90	92,9	91,2	14,9	11,4	5,3	10,5	71,0
91-180	23,8	30,8	13,0	21,6	17,8	2,2	0,0
>180	50,3	112,6	86,6	28,3	6,0	2,0	20,0
Total	1282,9	1420,9	637,4	484,5	135,9	150,9	647,6

^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	1.23%		1.02%	1.06%	1.10%
15-35	1.28%		1.30%	1.21%	1.27%
36-60	—		1.61%	5.54%	3.19%
61-90	1.45%		1.97%	1.42%	1.47%
91-180	—		1.68%	1.41%	1.65%
>180	1.73%		1.91%	1.71%	1.74%
Total	1.29%		1.17%	1.20%	1.22%

^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.

¹ 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.

² 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	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	7	27	642	731	46	104	4379	4629	21	143	5666	5043
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	419	349	0	0	2719	1854	0	0	2646	1845
Otros ^c	27	7	123	104	104	46	495	1101	143	21	641	2057
Total	34	34	1184	1184	150	150	7593	7584	164	164	8953	8945

^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.