

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2021
Fecha de Información: 09 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\$3023 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.34%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	481,2	505,3	339,3	291,7	114,7	138,2	51,3
15-35	810,9	750,2	558,3	581,4	12,7	50,4	179,2
36-60	182,0	54,8	10,0	114,8	9,8	32,2	35,0
61-90	104,8	164,6	132,2	60,0	2,4	14,8	30,0
91-180	25,9	12,4	0,0	10,0	12,4	15,9	0,0
>180	31,0	220,1	194,0	4,7	1,1	1,3	25,0
Total	1635,8	1707,5	1233,8	1062,6	153,2	252,8	320,5

^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	1.34%	1.38%	1.24%	1.30%
15-35	1.43%	1.31%	1.26%	1.31%
36-60	1.56%	1.55%	1.33%	1.41%
61-90	1.59%	1.53%	1.42%	1.53%
91-180	—	1.89%	1.53%	1.68%
>180	1.67%	1.66%	1.61%	1.66%
Total	1.46%	1.38%	1.27%	1.34%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	08 – 12 feb.				15 - 19 feb.				22 - 26 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	94	4339	4440	23	141	5947	5479	28	175	5742	5862
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2563	1962	0	0	2925	1981	0	0	3458	2014
Otros ^c	94	44	480	958	141	23	723	2129	175	28	570	1794
Total	138	138	7382	7360	164	164	9595	9589	203	203	9770	9670

^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.