

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2021
Fecha de Información: 10 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\$2382 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.84%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	623,7	585,6	317,0	385,8	117,9	87,2	150,8
15-35	597,7	606,8	403,3	369,6	30,9	55,5	172,6
36-60	14,1	44,0	30,0	0,0	9,0	9,1	5,0
61-90	54,1	105,7	50,0	17,0	23,7	5,1	32,0
91-180	27,7	36,8	0,4	0,0	19,9	11,2	16,5
>180	55,0	63,0	0,0	0,0	8,0	0,0	55,0
Total	1372,4	1441,8	800,6	772,4	209,3	168,1	431,9

^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	1.31%	1.28%	3.30%	2.33%
15-35	1.39%	1.49%	1.30%	1.42%
36-60	1.54%	1.59%	1.38%	1.54%
61-90	1.60%	1.68%	1.56%	1.62%
91-180	1.55%	1.76%	1.52%	1.63%
>180	1.66%	1.78%	1.26%	1.67%
Total	1.42%	1.45%	2.55%	1.84%

^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	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	24	88	4155	4315	23	144	6333	5740	28	177	5823	5905
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2476	2013	0	0	2956	2203	0	0	3468	2062
Otros ^c	88	24	478	760	144	23	792	2131	177	28	603	1828
Total	112	112	7109	7088	167	167	10081	10074	205	205	9894	9795

^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.