

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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 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.

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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.