

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 11 de febrero de 2021<sup>1</sup>**

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\$2231 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.35%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	579,2	351,4	85,1	319,0	70,8	64,8	195,5
15-35	452,4	666,4	526,0	328,9	18,8	2,0	121,5
36-60	6,3	113,6	87,8	0,0	25,8	6,3	0,0
61-90	191,2	91,4	40,0	140,0	11,4	11,2	40,0
91-180	46,8	52,7	0,0	0,0	37,7	31,8	15,0
>180	29,7	51,7	10,0	0,0	12,3	0,3	29,4
<b>Total</b>	<b>1305,6</b>	<b>1327,0</b>	<b>748,9</b>	<b>787,9</b>	<b>176,7</b>	<b>116,3</b>	<b>401,4</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.37%	1.18%	1.67%	1.47%
15-35	1.27%	1.16%	1.18%	1.19%
36-60	—	1.73%	1.28%	1.64%
61-90	1.48%	1.76%	1.29%	1.39%
91-180	1.46%	1.85%	1.47%	1.64%
>180	1.49%	1.91%	1.75%	1.61%
<b>Total</b>	<b>1.36%</b>	<b>1.27%</b>	<b>1.42%</b>	<b>1.35%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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 <sup>a</sup>	11	63	3111	3207	28	145	6458	5772	28	181	5978	6031
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1745	1444	0	0	2979	2336	0	0	3475	2155
Otros <sup>c</sup>	63	11	253	449	145	28	797	2118	181	28	669	1836
<b>Total</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>5109</b>	<b>5100</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>10234</b>	<b>10226</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>10122</b>	<b>10022</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.