

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 12 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\$2829 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.16%<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	288,3	956,0	225,2	233,1	702,8	27,2	28,1
15-35	610,2	335,6	107,8	287,7	50,8	145,5	176,9
36-60	6,6	26,0	0,0	0,0	26,0	6,6	0,0
61-90	317,6	83,8	10,0	52,9	23,0	213,8	50,9
91-180	340,4	24,7	0,3	0,0	24,4	340,4	0,0
>180	33,6	94,7	50,0	0,0	12,1	1,0	32,6
<b>Total</b>	<b>1596,7</b>	<b>1520,9</b>	<b>393,3</b>	<b>573,8</b>	<b>839,2</b>	<b>734,4</b>	<b>288,5</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	1.29%	0.79%	1.17%	0.87%
15-35	1.24%	1.35%	1.14%	1.21%
36-60	—	1.57%	1.21%	1.50%
61-90	1.47%	1.75%	1.43%	1.47%
91-180	—	1.80%	1.50%	1.52%
>180	1.60%	1.79%	1.66%	1.72%
<b>Total</b>	<b>1.33%</b>	<b>0.96%</b>	<b>1.32%</b>	<b>1.16%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	3	36	490	468	29	147	6669	6670	29	179	6061	6139
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	114	188	0	0	3175	2500	0	0	3549	2221
Otros <sup>c</sup>	36	3	135	81	147	29	1461	2128	179	29	703	1852
<b>Total</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>739</b>	<b>737</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>11305</b>	<b>11298</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>10313</b>	<b>10212</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.