

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2021
Fecha de Información: 12 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\$2829 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.16%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	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
Total	1596,7	1520,9	393,3	573,8	839,2	734,4	288,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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%
Total	1.33%		0.96%	1.32%	1.16%

^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	3	36	490	468	29	147	6669	6670	29	179	6061	6139
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	114	188	0	0	3175	2500	0	0	3549	2221
Otros ^c	36	3	135	81	147	29	1461	2128	179	29	703	1852
Total	39	39	739	737	176	176	11305	11298	208	208	10313	10212

^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.