

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 17 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\$1849 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.32%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	344,7	323,8	207,7	250,1	104,2	82,6	11,9
15-35	578,3	537,1	331,5	356,4	32,6	48,9	173,0
36-60	28,4	38,5	25,3	0,0	8,2	23,4	5,0
61-90	33,1	53,7	0,0	0,0	33,7	13,1	20,0
91-180	6,0	13,8	0,0	0,0	13,6	5,8	0,2
>180	45,6	82,2	55,6	10,0	1,1	10,1	25,5
<b>Total</b>	<b>1036,0</b>	<b>1049,1</b>	<b>620,1</b>	<b>616,5</b>	<b>193,4</b>	<b>183,9</b>	<b>235,6</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	1.05%		1.29%	1.10%	1.18%
15-35	1.36%		1.26%	1.41%	1.33%
36-60	1.57%		1.64%	1.23%	1.37%
61-90	1.59%		1.67%	1.41%	1.60%
91-180	1.40%		1.77%	1.34%	1.64%
>180	1.66%		1.81%	1.57%	1.67%
<b>Total</b>	<b>1.40%</b>		<b>1.33%</b>	<b>1.26%</b>	<b>1.32%</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	15 – 19 feb.				22 - 26 feb.				01 - 05 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	118	120	5211	5274	62	276	6377	6475	12	101	3872	3163
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3013	2259	0	0	3688	2514	0	1	1623	1839
Otros <sup>c</sup>	120	118	616	1307	276	62	897	1873	101	12	230	695
<b>Total</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>8840</b>	<b>8840</b>	<b>338</b>	<b>338</b>	<b>10962</b>	<b>10862</b>	<b>113</b>	<b>114</b>	<b>5725</b>	<b>5697</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.