

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2021**  
**Fecha de Información: 18 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\$3184 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	697,2	771,6	600,8	511	22,8	38,2	148,0
15-35	837,1	973,5	702,5	508	37,0	95,1	234,0
36-60	17,3	5,7	0,9	0	4,8	17,3	0,0
61-90	121,5	65,2	0,0	60	22,2	18,5	43,0
91-180	23,5	62,6	10,0	0	32,6	3,5	20,0
>180	34,7	21,1	10,3	30	9,5	3,4	1,3
<b>Total</b>	<b>1731,2</b>	<b>1899,6</b>	<b>1324,4</b>	<b>1109</b>	<b>128,9</b>	<b>175,9</b>	<b>446,3</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	1.38%	0.97%	0.94%	1.01%
15-35	1.36%	1.26%	1.19%	1.25%
36-60	—	1.91%	1.32%	1.45%
61-90	1.45%	1.65%	1.42%	1.50%
91-180	1.55%	1.65%	1.44%	1.61%
>180	1.76%	1.84%	1.71%	1.80%
<b>Total</b>	<b>1.38%</b>	<b>1.16%</b>	<b>1.06%</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$ . 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>	114	76	4078	4174	63	274	6695	6668	12	100	4021	3373
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2674	1929	0	0	3834	2779	0	1	1720	1874
Otros <sup>c</sup>	76	114	434	1083	274	63	910	1892	100	12	233	699
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7186</b>	<b>7186</b>	<b>337</b>	<b>337</b>	<b>11439</b>	<b>11339</b>	<b>112</b>	<b>113</b>	<b>5974</b>	<b>5946</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.