

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2021
Fecha de Información: 22 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\$2023 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.50%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	392,1	270,2	82,1	238,3	124,7	90,3	63,5
15-35	542,7	639,2	378,9	197,6	0,0	186,6	158,5
36-60	90,1	45,8	35,0	60,0	10,8	30,1	0,0
61-90	38,0	190,2	148,7	0,0	20,2	16,8	21,2
91-180	7,1	9,8	0,0	0,0	9,4	6,7	0,4
>180	17,9	23,9	17,6	6,0	5,9	11,6	0,3
Total	1087,9	1179,0	662,3	501,9	171,0	342,1	243,9

^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	1.55%		1.47%	1.18%	1.32%
15-35	1.70%		1.60%	1.48%	1.57%
36-60	—		1.62%	1.41%	1.51%
61-90	1.64%		1.66%	1.28%	1.61%
91-180	1.41%		1.69%	1.37%	1.55%
>180	1.60%		1.85%	1.73%	1.80%
Total	1.66%		1.59%	1.35%	1.50%

^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	22 – 26 feb.				01 - 05 mar.				08 - 12 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	179	287	7219	7319	15	100	4107	3422	22	96	4003	3462
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4110	3067	0	1	1750	1925	0	0	2114	1645
Otros ^c	287	179	1155	1998	100	14	236	720	96	22	351	959
Total	466	466	12484	12384	115	115	6093	6067	118	118	6468	6066

^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.