

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2021
Fecha de Información: 24 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\$2334 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.29%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	628,7	417,6	221,7	406,1	54,5	81,2	141,4
15-35	732,7	770,8	363,4	304,7	39,7	60,4	367,6
36-60	43,5	6,2	1,2	0,0	5,0	43,5	0,0
61-90	11,8	42,7	0,4	0,0	42,3	11,8	0,0
91-180	3,7	107,3	102,6	0,0	4,7	3,7	0,0
>180	34,8	53,4	40,0	10,0	3,1	14,5	10,3
Total	1455,3	1397,9	729,3	720,9	149,3	215,1	519,3

^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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.39%		1.28%	1.13%	1.21%
15-35	1.31%		1.37%	1.20%	1.31%
36-60	-		1.75%	1.38%	1.42%
61-90	-		1.69%	1.40%	1.62%
91-180	-		1.44%	1.49%	1.44%
>180	1.90%		1.88%	1.78%	1.82%
Total	1.35%		1.37%	1.19%	1.29%

^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.

¹A 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.

²El 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	74	249	5732	5677	24	101	4308	3663	25	97	4280	3720
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3173	2803	0	1	1800	2068	0	0	2256	1782
Otros ^c	249	74	1055	1409	101	24	371	721	96	25	357	988
Total	323	323	9960	9889	125	126	6479	6452	121	122	6893	6490

^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.