INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2021
Fecha de Información: 04 de febrero de 2021[1]

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$2073 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.08%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	380,6	371,1	223,8	226,4	75,4	82,3	72,0
15-35	440,0	680,2	488,4	205,5	16,7	59,4	175,1
36-60	49,7	14,4	0,0	0,0	14,4	49,7	0,0
61-90	81,4	46,5	10,1	30,0	1,4	16,4	35,0
91-180	2,9	83,7	65,3	0,0	17,6	2,1	0,8
>180	160,0	105,4	44,0	99,0	1,4	1,0	60,0
Total	**1114,6**	**1301,4**	**831,6**	**560,9**	**126,8**	**210,8**	**342,9**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	1.26%	1.08%	0.64%	0.92%
15-35	1.04%	1.08%	0.97%	1.03%
36-60	–	1.54%	1.09%	1.19%
61-90	1.29%	1.37%	1.27%	1.30%
91-180	1.31%	1.76%	1.32%	1.70%
>180	1.95%	1.72%	1.57%	1.86%
Total	**1.27%**	**1.14%**	**0.88%**	**1.08%**

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	01 – 05 feb.				08 - 12 feb.				15 - 19 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	10	47	2247	2418	45	101	4139	4315	21	142	5508	4960
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1542	1250	0	0	2558	1778	0	0	2603	1734
Otros[c]	47	10	247	358	101	45	410	1007	142	21	641	2051
Total	**57**	**57**	**4036**	**4026**	**146**	**146**	**7107**	**7100**	**163**	**163**	**8752**	**8745**

[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.