

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2021
Fecha de Información: 15 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\$710 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.11%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	302,6	296,8	177,7	183,4	99,0	99,2	20
15-35	57,5	40,0	17,0	53,6	20,0	0,9	3
36-60	2,1	6,2	0,0	0,0	6,2	2,1	0
61-90	1,1	11,8	0,0	0,0	11,8	1,1	0
91-180	0,2	10,2	0,0	0,0	10,2	0,2	0
>180	0,5	3,6	0,0	0,0	3,6	0,5	0
Total	364,1	368,6	194,8	237,0	150,8	104,1	23

^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	1.20%		1.03%	1.06%	1.05%
15-35	1.32%		1.46%	1.17%	1.36%
36-60	-		1.70%	1.03%	1.53%
61-90	-		1.76%	1.29%	1.72%
91-180	-		1.79%	1.29%	1.78%
>180	-		2.09%	1.43%	2.01%
Total	1.22%		1.15%	1.06%	1.11%

^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	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 ^a	29	147	6771	6795	29	180	6134	6236	10	101	3672	2972
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3300	2507	0	0	3549	2291	0	1	1544	1780
Otros ^c	147	29	1462	2224	180	29	798	1855	101	9	227	664
Total	176	176	11533	11526	209	209	10481	10382	111	111	5443	5416

^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.