

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2021
Fecha de Información: 16 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\$1781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.27%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	375,5	392,6	176,7	182,5	157,4	134,5	58,5
15-35	525,3	440,0	236,0	218,8	19,5	122,0	184,5
36-60	68,5	70,2	30,0	30,0	10,2	8,5	30,0
61-90	72,8	101,6	20,0	0,0	11,6	2,8	70,0
91-180	4,8	31,6	20,0	0,0	11,3	4,5	0,3
>180	27,2	14,5	5,0	20,0	9,5	7,2	0,0
Total	1074,2	1050,5	487,7	451,3	219,5	279,6	343,3

^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	1.27%		1.32%	1.18%	1.25%
15-35	1.15%		1.27%	1.17%	1.20%
36-60	1.50%		1.41%	1.18%	1.43%
61-90	1.57%		1.61%	1.36%	1.57%
91-180	1.50%		1.78%	1.36%	1.66%
>180	-		1.88%	1.54%	1.77%
Total	1.29%		1.34%	1.18%	1.27%

^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	123	147	6966	7093	47	274	6205	6309	10	101	3768	3029
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3460	2646	0	0	3591	2353	0	1	1551	1804
Otros ^c	147	123	1551	2231	274	47	830	1864	101	9	227	686
Total	270	270	11977	11970	321	321	10626	10526	111	111	5546	5519

^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.