

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2021
Fecha de Información: 19 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\$1347 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.22%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	248,0	398,6	214,7	99,8	104,9	69,2	79,0
15-35	355,6	329,7	199,3	232,7	30,4	22,8	100,0
36-60	10,3	1,0	0,0	0,1	1,0	10,2	0,0
61-90	91,0	54,8	15,0	0,0	9,8	61,0	30,0
91-180	2,4	15,7	12,1	0,0	3,7	2,4	0,0
>180	40,4	41,9	0,0	3,3	8,1	3,3	33,8
Total	747,7	841,8	441,1	336,0	157,9	168,9	242,8

^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	1.31%		0.91%	0.82%	0.95%
15-35	1.44%		1.48%	1.22%	1.36%
36-60	-		1.47%	1.29%	1.30%
61-90	1.61%		1.78%	1.37%	1.52%
91-180	-		2.09%	1.41%	1.82%
>180	1.70%		1.77%	1.73%	1.71%
Total	1.45%		1.20%	1.13%	1.22%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	8	39	837	959	175	278	6829	6947	13	100	4086	3399
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	576	97	0	0	3971	2829	0	1	1727	1925
Otros ^c	39	8	75	432	278	175	1012	1936	100	12	236	699
Total	47	47	1488	1488	453	453	11812	11712	113	113	6049	6023

^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.