

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2021
Fecha de Información: 23 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\$3082 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.47%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupa y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 495,5 | 774,6 | 318,2 | 323,3 | 383,9 | 99,8 | 72,5 |
| 15-35 | 1014,2 | 601,9 | 368,6 | 574,2 | 23,7 | 230,4 | 209,5 |
| 36-60 | 44,1 | 34,7 | 20,0 | 0,0 | 4,7 | 34,1 | 10,0 |
| 61-90 | 83,0 | 155,6 | 140,2 | 0,0 | 15,4 | 83,0 | 0,0 |
| 91-180 | 15,1 | 37,8 | 20,0 | 0,0 | 7,8 | 5,1 | 10,0 |
| >180 | 69,6 | 66,8 | 47,4 | 47,4 | 10,5 | 13,3 | 8,9 |
| Total | 1721,6 | 1671,4 | 914,5 | 945,0 | 446,0 | 465,7 | 310,9 |

^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

| Rango | Intermediarios del Mercado Cambiario ^a | | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.51% | | 1.40% | 1.25% | 1.36% |
| 15-35 | 1.48% | | 1.55% | 1.48% | 1.50% |
| 36-60 | 1.52% | | 1.63% | 1.46% | 1.51% |
| 61-90 | - | | 1.61% | 1.51% | 1.57% |
| 91-180 | 1.56% | | 1.89% | 1.56% | 1.67% |
| >180 | 1.63% | | 1.87% | 1.58% | 1.73% |
| Total | 1.50% | | 1.50% | 1.42% | 1.47% |

^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 | 75 | 262 | 6828 | 6832 | 18 | 100 | 4189 | 3554 | 22 | 96 | 4009 | 3507 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3832 | 3326 | 0 | 1 | 1750 | 1965 | 0 | 0 | 2156 | 1645 |
| Otros ^c | 262 | 75 | 1284 | 1707 | 100 | 17 | 326 | 720 | 96 | 22 | 354 | 964 |
| Total | 337 | 337 | 11944 | 11865 | 118 | 118 | 6265 | 6239 | 118 | 118 | 6519 | 6116 |

^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.