

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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$. 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.