

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de marzo de 2021
Fecha de Información: 25 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\$2340 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.87%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	477,4	226,2	97,7	298,7	41,1	91,2	87,5
15-35	672,2	738,0	479,8	411,2	58,6	61,4	199,7
36-60	41,9	34,3	0,0	0,0	3,9	11,5	30,4
61-90	114,5	64,0	40,0	0,0	4,0	94,5	20,0
91-180	80,6	267,9	190,0	0,0	15,4	18,1	62,5
>180	18,4	4,8	0,0	0,0	4,5	18,1	0,3
Total	1405,0	1335,2	807,4	710,0	127,5	294,7	400,4

^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	1.24%		1.17%	0.74%	0.93%
15-35	1.21%		1.20%	-1.00%	0.64%
36-60	1.02%		2.19%	1.22%	1.17%
61-90	1.30%		1.69%	1.30%	1.32%
91-180	1.40%		1.50%	1.20%	1.41%
>180	1.55%		1.92%	1.42%	1.52%
Total	1.24%		1.24%	0.27%	0.87%

^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	62	181	2212	2071	27	98	4424	3751	27	96	4342	3751
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1034	1017	0	1	1855	2153	0	0	2256	1838
Otros ^c	181	62	440	598	98	26	375	724	96	27	388	995
Total	243	243	3686	3686	125	125	6654	6628	123	123	6986	6584

^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.