

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de marzo de 2021
Fecha de Información: 26 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\$2344 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.14%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	313,3	401,0	173,0	152,7	143,5	76,1	84,5
15-35	733,1	622,2	374,8	267,7	46,7	264,7	200,7
36-60	31,1	13,5	0,0	0,0	13,5	31,1	0,0
61-90	90,7	14,1	0,0	0,4	14,1	90,3	0,0
91-180	130,2	111,7	103,5	106,4	8,1	23,8	0,0
>180	83,0	85,8	76,4	51,7	9,4	31,3	0,0
Total	1381,4	1248,2	727,8	578,9	235,3	517,4	285,2

^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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.25%		1.13%	0.59%	0.98%
15-35	1.19%		1.16%	1.09%	1.13%
36-60	-		1.55%	0.93%	1.12%
61-90	-		1.49%	1.18%	1.22%
91-180	-		1.52%	1.07%	1.42%
>180	-		1.63%	1.48%	1.51%
Total	1.21%		1.23%	1.04%	1.14%

^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 intragruppo.

“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	51	59	964	972	32	100	4693	4070	29	97	4432	3855
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	564	558	0	1	2008	2279	0	0	2269	1889
Otros ^c	59	51	182	179	100	31	459	783	97	29	447	1002
Total	110	110	1710	1709	132	132	7160	7132	126	126	7148	6746

^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.