

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de marzo de 2021
Fecha de Información: 01 de marzo 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\$2110 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	511,4	181,7	82,8	409,2	9,4	12,6	89,5
15-35	470,1	795,6	604,7	219,3	6,4	66,3	184,5
36-60	36,4	22,4	10,0	0,0	12,4	36,4	0,0
61-90	139,6	6,1	1,5	120,0	4,6	19,6	0,0
91-180	74,4	66,7	60,0	21,4	6,5	52,7	0,2
>180	1,8	78,3	76,4	0,0	1,9	1,8	0,0
Total	1233,6	1150,9	835,4	770,0	41,3	189,4	274,2

^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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.04%		1.36%	1.34%	1.27%
15-35	1.26%		1.14%	0.54%	0.99%
36-60	-		1.39%	1.09%	1.17%
61-90	-		1.65%	1.23%	1.31%
91-180	1.49%		1.60%	1.38%	1.45%
>180	-		1.69%	1.46%	1.68%
Total	1.19%		1.26%	1.02%	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 intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	01 – 05 mar.				08 - 12 mar.				15 - 19 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	34	105	5016	4225	31	97	4554	3922	23	129	5859	5806
Intragrupo y off-shore ^b	0	1	2070	2508	0	0	2295	1972	0	0	3201	2305
Otros ^c	105	33	462	788	97	31	453	1006	129	23	1210	2142
Total	139	139	7548	7521	128	128	7302	6900	152	152	10270	10253

^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.