

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2974 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.56%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	477,4	642,4	253,7	332,0	279,7	36,5	109,0
15-35	452,7	862,8	648,0	245,8	38,6	30,8	176,2
36-60	138,0	26,7	10,0	30,0	11,7	103,0	5,0
61-90	299,7	17,8	0,0	13,0	17,8	286,7	0,0
91-180	163,5	182,5	90,0	59,0	22,5	34,5	70,0
>180	0,5	70,6	47,9	0,0	22,3	0,2	0,3
Total	1531,8	1802,7	1049,6	679,7	392,7	491,6	360,5

^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	0.32%		0.28%	0.26%	0.28%
15-35	0.45%		0.39%	0.39%	0.41%
36-60	0.92%		1.61%	0.87%	0.94%
61-90	-		1.16%	0.86%	0.88%
91-180	1.27%		1.36%	1.14%	1.28%
>180	1.40%		1.99%	1.73%	1.98%
Total	0.58%		0.49%	0.63%	0.56%

^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	15 – 19 mar.				22 - 26 mar.				29 mar. - 02 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	140	8871	9763	32	106	3047	2205	21	82	4505	4625
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4527	4382	0	0	892	1035	2	0	2591	2005
Otros ^c	140	33	3158	2396	106	32	806	1503	80	21	362	828
Total	173	173	16556	16541	138	138	4745	4743	103	103	7458	7458

^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.