

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2021
Fecha de Información: 16 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\$2785 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.55%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	603,1	373,3	116,5	473,3	168,3	41,3	88,5
15-35	562,9	1027,2	654,8	223,4	42,0	9,1	330,4
36-60	187,2	209,0	87,1	76,0	21,9	11,2	100,0
61-90	177,6	9,4	0,0	15,0	9,4	162,6	0,0
91-180	54,5	78,7	24,2	10,0	14,5	4,5	40,0
>180	49,9	40,6	0,0	10,0	11,1	10,4	29,5
Total	1635,3	1738,2	882,6	807,7	267,2	239,2	588,4

^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	0.37%		0.43%	0.29%	0.35%
15-35	0.47%		0.45%	0.40%	0.45%
36-60	1.00%		0.85%	0.61%	0.95%
61-90	-		1.36%	0.90%	0.93%
91-180	1.23%		1.41%	1.15%	1.29%
>180	1.50%		1.96%	1.70%	1.65%
Total	0.65%		0.51%	0.51%	0.55%

^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	26	116	5781	6287	32	107	3193	2290	21	83	4582	4658
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3009	3116	0	0	946	1128	2	0	2591	2036
Otros ^c	116	26	1787	1159	107	32	808	1528	80	21	364	843
Total	142	142	10577	10562	139	139	4947	4946	103	104	7537	7537

^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.