

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de marzo de 2021
Fecha de Información: 18 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\$2522 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.52%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	324,1	679,0	466,1	242,8	145,9	14,3	67
15-35	641,1	501,4	356,6	493,6	28,8	31,5	116
36-60	40,8	11,5	0,0	0,0	11,5	40,8	0
61-90	308,2	47,4	0,0	100,0	12,4	173,2	35
91-180	117,1	20,9	0,0	116,8	20,9	0,3	0
>180	30,2	18,2	10,0	0,0	8,2	30,2	0
Total	1461,4	1278,5	832,7	953,2	227,8	290,2	218

^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	0.09%		0.42%	0.34%	0.36%
15-35	0.37%		0.48%	0.35%	0.40%
36-60	-		1.01%	0.63%	0.72%
61-90	0.92%		1.67%	0.92%	0.95%
91-180	-		1.43%	0.60%	1.42%
>180	-		1.87%	1.49%	1.63%
Total	0.37%		0.53%	0.55%	0.52%

^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	7	65	4026	4157	41	109	3246	2722	25	82	4861	4998
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2255	2448	0	0	1326	1137	2	0	2737	2222
Otros ^c	65	7	1012	683	109	41	845	1556	80	24	467	845
Total	72	72	7293	7288	150	150	5417	5415	107	106	8065	8065

^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.