

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2021
Fecha de Información: 19 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\$2395 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.67%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	239,6	335,0	157,9	140,0	177,2	99,6	0,0
15-35	733,9	598,9	178,6	286,3	104,9	132,3	315,3
36-60	11,1	45,5	7,0	0,0	38,5	11,1	0,0
61-90	67,6	110,1	12,6	0,0	47,5	17,6	50,0
91-180	312,5	411,3	160,0	70,0	16,3	7,5	235,0
>180	48,2	101,8	70,0	10,0	11,8	18,2	20,0
Total	1412,9	1602,6	586,1	506,3	396,2	286,3	620,3

^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	-		0.46%	0.13%	0.32%
15-35	0.43%		0.53%	0.36%	0.42%
36-60	-		0.59%	0.37%	0.54%
61-90	0.92%		1.15%	1.07%	1.05%
91-180	1.14%		1.14%	1.43%	1.18%
>180	1.43%		1.70%	1.42%	1.58%
Total	0.77%		0.76%	0.45%	0.67%

^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	40	1246	1385	44	110	3348	2894	25	82	4962	5157
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	774	709	0	0	1454	1189	2	0	2767	2282
Otros ^c	40	7	301	227	110	44	889	1606	79	24	597	887
Total	47	47	2321	2321	154	154	5691	5689	106	106	8326	8326

^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.