

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de marzo de 2021
Fecha de Información: 23 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\$1797 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.58%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	216,8	396,2	329,2	138,4	10,2	21,6	56,8
15-35	432,1	553,7	430,8	276,7	39,4	71,9	83,5
36-60	36,7	31,7	8,9	0,0	22,8	36,7	0,0
61-90	25,7	9,0	3,5	0,0	5,5	25,7	0,0
91-180	104,9	75,1	30,0	0,0	15,1	74,9	30,0
>180	51,5	33,9	25,0	25,0	8,9	26,5	0,0
Total	867,7	1099,5	827,5	440,1	101,8	257,3	170,3

^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	0.30%		0.47%	0.31%	0.39%
15-35	0.45%		0.48%	0.35%	0.44%
36-60	-		0.64%	0.59%	0.61%
61-90	-		1.38%	0.88%	1.01%
91-180	1.08%		1.24%	1.05%	1.11%
>180	-		1.81%	1.69%	1.72%
Total	0.51%		0.58%	0.61%	0.58%

^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	22 – 26 mar.				29 mar. - 02 abr.				05 - 09 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	116	3385	3161	26	80	5070	5224	27	186	4339	4624
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1678	1221	2	0	2812	2365	0	0	2781	2234
Otros ^c	116	47	895	1575	78	25	598	891	186	27	392	646
Total	163	163	5958	5957	106	105	8480	8480	213	213	7512	7504

^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.