

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2021
Fecha de Información: 24 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\$2669 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.72%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	263,8	614,6	219,0	146,9	293,6	14,9	102,0
15-35	537,9	647,8	429,0	270,6	16,8	65,3	201,9
36-60	56,9	26,1	0,0	0,0	14,1	44,9	12,0
61-90	364,8	139,9	44,0	1,7	15,9	283,2	80,0
91-180	189,3	177,4	72,5	110,0	43,4	17,8	61,5
>180	73,1	64,9	30,9	33,1	4,0	9,9	30,0
Total	1485,8	1670,8	795,5	562,4	387,9	436,0	487,4

^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	0.51%		0.35%	0.38%	0.38%
15-35	0.59%		0.62%	0.53%	0.58%
36-60	0.51%		0.99%	0.66%	0.70%
61-90	0.94%		1.09%	1.03%	1.02%
91-180	1.20%		1.40%	1.31%	1.32%
>180	1.79%		1.98%	1.40%	1.70%
Total	0.78%		0.64%	0.78%	0.72%

^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	37	94	1938	1919	18	81	5133	5296	39	187	4393	4711
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	769	507	2	0	2866	2416	0	0	2834	2247
Otros ^c	94	37	896	1176	79	18	601	889	187	39	393	653
Total	131	131	3603	3602	99	99	8600	8601	226	226	7620	7611

^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.