

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2021
Fecha de Información: 25 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\$2986 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.66%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1207,6	939,7	243,4	584,7	86,8	13,5	609,4
15-35	659,7	800,8	524,3	219,5	17,5	181,3	259,0
36-60	18,4	7,7	0,0	4,8	3,7	9,6	4,0
61-90	24,1	21,3	15,0	0,0	6,3	24,1	0,0
91-180	36,4	49,6	28,0	3,4	11,1	22,5	10,5
>180	81,6	72,2	20,0	20,0	2,2	11,6	50,0
Total	2027,9	1891,2	830,7	832,4	127,6	262,6	932,9

^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	0.61%		0.62%	0.56%	0.59%
15-35	0.63%		0.66%	0.55%	0.62%
36-60	0.68%		-4.02%	0.78%	-0.04%
61-90	-		1.17%	1.04%	1.10%
91-180	1.20%		1.44%	1.15%	1.23%
>180	1.55%		1.80%	1.59%	1.61%
Total	0.67%		0.68%	0.63%	0.66%

^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	30	66	1545	1522	18	82	5567	5580	45	186	4974	5259
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	557	427	2	0	2923	2632	0	0	2954	2482
Otros ^c	66	30	732	885	79	18	601	880	186	45	475	654
Total	96	96	2834	2834	99	100	9091	9092	231	231	8403	8395

^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.