

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2021
Fecha de Información: 29 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\$1985 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.22%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 | 463,5 | 196,2 | 159,7 | 368,8 | 7,5 | 65,7 | 29 |
| 15-35 | 525,0 | 882,5 | 567,4 | 216,3 | 70,0 | 63,7 | 245 |
| 36-60 | 45,7 | 28,9 | 0,0 | 0,0 | 23,9 | 40,7 | 5 |
| 61-90 | 2,2 | 19,6 | 16,5 | 0,2 | 3,1 | 2,0 | 0 |
| 91-180 | 68,8 | 38,2 | 0,0 | 10,0 | 8,2 | 28,8 | 30 |
| >180 | 18,2 | 18,0 | 0,0 | 0,0 | 5,0 | 5,2 | 13 |
| Total | 1123,5 | 1183,5 | 743,6 | 595,4 | 117,8 | 206,1 | 322 |

^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 | 0.18% | | 0.14% | 0.10% | 0.11% |
| 15-35 | 0.16% | | 0.18% | 0.13% | 0.17% |
| 36-60 | 0.72% | | 0.39% | 0.29% | 0.36% |
| 61-90 | - | | 1.00% | 0.59% | 0.96% |
| 91-180 | 1.03% | | 1.39% | 0.92% | 1.03% |
| >180 | 1.56% | | 1.85% | 1.32% | 1.57% |
| Total | 0.31% | | 0.23% | 0.16% | 0.22% |

^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 | 29 mar. - 02 abr. | | | | 05 - 09 abr. | | | | 12 - 16 abr. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 24 | 103 | 5862 | 5852 | 60 | 188 | 5649 | 5478 | 45 | 113 | 4455 | 5084 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 2 | 0 | 3136 | 2890 | 0 | 0 | 2989 | 3042 | 0 | 0 | 3104 | 1796 |
| Otros ^c | 101 | 24 | 629 | 886 | 188 | 60 | 603 | 712 | 113 | 45 | 647 | 1312 |
| Total | 127 | 127 | 9627 | 9628 | 248 | 248 | 9241 | 9232 | 158 | 158 | 8206 | 8192 |

^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.