

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de abril de 2021
Fecha de Información: 30 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\$1921 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.33%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	394,9	378,4	203,0	236,6	26,9	9,8	148,5
15-35	523,0	587,5	396,4	328,0	0,0	68,0	127,0
36-60	56,2	21,5	0,0	0,0	21,5	56,2	0,0
61-90	18,3	10,3	0,7	0,0	0,0	18,3	0,0
91-180	18,8	51,4	0,0	0,0	0,0	18,3	0,5
>180	104,6	80,4	30,0	33,2	1,9	23,0	48,5
Total	1115,8	1129,4	630,1	597,8	50,3	193,5	324,5

^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	0.22%		0.11%	0.16%	0.15%
15-35	0.11%		0.18%	0.04%	0.11%
36-60	-		0.58%	0.11%	0.24%
61-90	0.52%		1.10%	0.56%	0.74%
91-180	0.96%		1.21%	0.97%	1.14%
>180	1.87%		1.91%	1.65%	1.78%
Total	0.42%		0.32%	0.29%	0.33%

^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	11	68	4306	4382	61	189	5983	5667	46	113	4588	5151
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	2590	2264	0	0	3052	3262	0	0	3129	1878
Otros ^c	65	10	428	677	189	61	621	718	113	46	650	1325
Total	78	78	7324	7323	250	250	9656	9647	159	159	8367	8354

^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.