

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de abril de 2021
Fecha de Información: 31 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\$1238 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.30%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	174,9	120,5	90,3	147,5	20,2	17,4	10
15-35	316,3	450,3	360,2	207,8	15,1	33,5	75
36-60	7,9	104,4	75,0	0,0	29,4	7,9	0
61-90	5,6	12,9	4,7	0,0	8,2	5,6	0
91-180	18,5	39,9	0,0	0,0	39,9	18,5	0
>180	46,5	66,8	5,0	1,0	20,8	4,5	41
Total	569,8	794,6	535,2	356,3	133,5	87,4	126

^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	0.12%		0.11%	-0.05%	0.03%
15-35	0.18%		0.10%	0.01%	0.07%
36-60	-		0.46%	0.22%	0.43%
61-90	-		1.14%	0.52%	0.89%
91-180	-		1.29%	0.95%	1.18%
>180	1.84%		1.63%	1.41%	1.74%
Total	0.71%		0.37%	0.08%	0.30%

^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	6	27	450	527	62	194	6120	5785	46	113	4686	5172
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	327	304	0	0	3111	3339	0	0	3149	1972
Otros ^c	27	6	134	81	194	62	636	734	113	46	651	1328
Total	33	33	911	912	256	256	9867	9858	159	159	8486	8472

^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.