

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de abril de 2021
Fecha de Información: 05 de abril 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\$1709 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.50%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	491,4	297,9	84,1	322,5	70,3	25,4	143,5
15-35	205,4	437,6	254,8	78,9	73,1	16,8	109,8
36-60	12,1	243,2	229,0	3,5	14,2	8,6	0,0
61-90	17,2	77,5	35,5	1,0	27,0	1,1	15,0
91-180	76,0	132,1	2,9	1,4	57,9	3,3	71,3
>180	20,8	42,0	34,6	10,0	2,4	5,8	5,0
Total	822,8	1230,4	641,0	417,3	244,9	61,0	344,5

^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	0.14%		0.18%	0.07%	0.14%
15-35	0.16%		0.57%	0.07%	0.35%
36-60	-		0.70%	0.26%	0.54%
61-90	0.93%		1.04%	0.53%	1.01%
91-180	1.46%		1.22%	0.84%	1.34%
>180	1.46%		1.91%	1.36%	1.79%
Total	0.47%		0.68%	0.13%	0.50%

^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	05 – 09 abr.				12 - 16 abr.				19 - 23 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	68	196	6260	5911	48	114	4942	5320	21	123	3752	4183
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3163	3412	0	0	3172	2157	0	0	2486	1622
Otros ^c	196	68	658	749	114	48	715	1331	123	21	429	837
Total	264	264	10081	10072	162	162	8829	8808	144	144	6667	6642

^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.