

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de abril de 2021
Fecha de Información: 06 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\$2065 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.57%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	424,6	641,7	447,2	233,6	18,6	15,0	175,9
15-35	499,8	366,8	180,6	360,4	69,2	22,4	117,0
36-60	141,0	125,7	45,0	30,0	22,2	52,5	58,5
61-90	6,7	32,8	12,5	0,0	15,3	1,7	5,0
91-180	137,4	140,6	0,0	0,0	15,6	12,4	125,0
>180	12,9	26,5	0,0	0,0	16,5	2,9	10,0
Total	1222,4	1334,0	685,3	624,0	157,2	107,0	491,4

^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	0.52%		0.31%	0.29%	0.37%
15-35	0.54%		0.44%	0.34%	0.41%
36-60	0.91%		0.93%	0.56%	0.77%
61-90	0.82%		1.10%	0.56%	1.03%
91-180	1.32%		1.46%	0.75%	1.29%
>180	1.56%		2.01%	1.70%	1.83%
Total	0.80%		0.53%	0.38%	0.57%

^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	63	172	5633	5403	47	115	5125	5487	21	124	3919	4357
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2901	3063	0	0	3328	2298	0	0	2625	1745
Otros ^c	172	63	521	586	115	47	686	1333	124	21	424	842
Total	235	235	9055	9052	162	162	9139	9118	145	145	6968	6944

^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.