

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2021
Fecha de Información: 09 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\$2565 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.16%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	683,9	847,6	106,1	184,4	291,5	49,5	450,0
15-35	485,9	678,3	356,5	164,1	20,3	20,3	301,5
36-60	53,9	28,1	0,0	0,0	28,1	53,9	0,0
61-90	203,9	3,2	0,0	0,0	3,2	203,9	0,0
91-180	176,1	133,3	70,0	10,0	8,3	111,1	55,0
>180	50,6	77,1	25,0	0,0	2,1	0,6	50,0
Total	1654,3	1767,6	557,6	358,5	353,5	439,3	856,5

^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	0.96%		0.99%	1.05%	0.99%
15-35	1.19%		1.20%	1.14%	1.18%
36-60	-		1.48%	1.21%	1.30%
61-90	-		1.60%	1.31%	1.31%
91-180	1.54%		1.49%	1.39%	1.45%
>180	1.89%		1.99%	1.54%	1.89%
Total	1.13%		1.14%	1.21%	1.16%

^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	6	104	334	381	50	128	6024	6687	22	125	4168	4531
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	196	148	0	0	3525	2587	0	0	2697	1866
Otros ^c	104	6	101	102	128	50	1143	1396	125	22	441	885
Total	110	110	631	631	178	178	10692	10670	147	147	7306	7282

^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.