

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2021
Fecha de Información: 12 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\$1020 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.36%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	134,8	254,8	177,6	54,0	35,4	38,9	41,9
15-35	259,9	213,8	171,3	205,4	10,2	22,2	32,2
36-60	23,3	67,2	50,2	0,0	16,5	22,9	0,4
61-90	4,6	15,9	0,0	0,0	15,9	4,6	0,0
91-180	19,3	74,9	40,0	0,3	24,4	8,6	10,5
>180	12,8	33,0	18,0	0,1	5,5	3,1	9,6
Total	454,6	659,6	457,1	259,8	107,9	100,2	94,5

^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	1.40%		1.29%	24.10%	1.29%
15-35	1.35%		1.45%	1.24%	1.31%
36-60	1.44%		1.61%	1.31%	1.44%
61-90	-		1.60%	1.47%	1.57%
91-180	1.54%		1.59%	1.43%	1.57%
>180	2.06%		1.85%	1.59%	1.89%
Total	1.46%		1.42%	1.26%	1.36%

^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	12 – 16 abr.				19 - 23 abr.				26 - 30 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	135	6182	6909	23	126	4251	4637	36	123	2272	3538
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3688	2667	0	0	2779	1933	0	0	2184	859
Otros ^c	135	44	1151	1424	126	23	454	889	123	36	581	621
Total	179	179	11021	11000	149	149	7484	7459	159	159	5037	5018

^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.