

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2021
Fecha de Información: 13 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\$2044 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.26%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	443,8	495,5	182,4	224,3	208,5	115,0	104,6
15-35	502,4	443,6	184,3	255,0	45,9	34,1	213,3
36-60	24,2	79,8	70,0	10,8	9,8	13,4	0,0
61-90	109,9	4,5	0,0	0,0	4,5	109,9	0,0
91-180	36,3	127,9	61,1	0,0	36,8	6,3	30,0
>180	104,3	80,0	16,0	42,5	4,0	1,8	60,0
Total	1220,8	1231,2	513,8	532,5	309,4	280,4	407,9

^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	1.35%		0.93%	0.91%	1.00%
15-35	1.38%		1.42%	1.24%	1.34%
36-60	-		1.66%	1.41%	1.48%
61-90	-		1.72%	1.43%	1.44%
91-180	1.58%		1.62%	1.39%	1.59%
>180	2.01%		2.12%	2.15%	2.03%
Total	1.48%		1.18%	1.16%	1.26%

^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	40	118	5679	6343	24	127	4391	4812	39	120	2348	3599
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3406	2449	0	0	2834	2058	0	0	2197	879
Otros ^c	118	40	1026	1298	127	24	555	886	120	39	586	635
Total	158	158	10111	10090	151	151	7780	7756	159	159	5131	5113

^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.