

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2560 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.40%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	758,5	482,7	184,4	509,4	148,3	99,1	150,0
15-35	573,6	750,0	452,0	254,9	107,2	128,0	190,8
36-60	9,5	55,8	0,0	2,5	55,8	7,0	0,0
61-90	18,0	76,8	41,6	10,0	35,2	8,0	0,0
91-180	32,1	98,8	42,2	0,0	55,1	30,6	1,5
>180	15,8	33,6	10,0	10,0	20,3	2,5	3,3
Total	1407,5	1497,6	730,2	786,8	421,9	275,1	345,6

^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	1.48%		1.56%	1.00%	1.25%
15-35	1.47%		1.43%	1.38%	1.42%
36-60	-		1.86%	1.42%	1.81%
61-90	-		1.84%	1.51%	1.73%
91-180	1.50%		1.84%	1.45%	1.70%
>180	1.55%		2.26%	1.33%	2.13%
Total	1.48%		1.56%	1.18%	1.40%

^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	17	75	4048	4439	29	132	5403	5505	41	129	2747	3770
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2141	1958	0	0	3168	2502	0	0	2303	1017
Otros ^c	75	17	1124	911	132	29	676	1216	129	41	601	846
Total	92	92	7313	7308	161	161	9247	9223	170	170	5651	5633

^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.