

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2021
Fecha de Información: 16 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\$1708 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.33%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	467,3	400,5	204,6	345,3	126,9	53,1	69,0
15-35	326,4	406,7	271,7	132,0	50,1	109,4	85,0
36-60	3,6	40,2	0,0	1,1	40,2	2,5	0,0
61-90	18,0	38,7	0,6	0,0	32,6	12,5	5,5
91-180	33,5	66,9	0,9	0,0	46,0	13,5	20,0
>180	46,3	50,0	35,0	10,0	4,0	25,3	11,0
Total	895,2	1003,0	512,8	488,4	299,7	216,3	190,5

^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	1.16%		1.10%	1.29%	1.20%
15-35	1.35%		1.42%	1.25%	1.35%
36-60	-		1.66%	0.84%	1.61%
61-90	1.38%		1.63%	1.06%	1.46%
91-180	1.51%		1.57%	1.47%	1.54%
>180	1.80%		1.81%	2.24%	1.99%
Total	1.33%		1.34%	1.33%	1.33%

^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	5	37	357	543	33	135	5786	5790	41	137	2806	3848
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	285	236	0	0	3298	2798	0	0	2350	1051
Otros ^c	37	5	195	57	135	33	787	1260	137	41	612	851
Total	42	42	837	836	168	168	9871	9848	178	178	5768	5750

^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.