

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2021
Fecha de Información: 20 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\$3126 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.30%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	969,8	653,9	192,5	456,5	259,4	311,3	202
15-35	600,9	920,7	631,0	289,7	53,7	75,2	236
36-60	47,7	5,4	0,0	29,0	5,4	18,7	0
61-90	74,4	71,8	59,0	0,0	4,8	66,4	8
91-180	5,7	10,1	0,0	0,0	10,1	5,7	0
>180	118,2	158,8	75,0	30,0	18,8	23,2	65
Total	1816,7	1820,6	957,5	805,2	352,1	500,5	511

^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	1.38%		1.48%	1.05%	1.23%
15-35	1.32%		1.27%	1.29%	1.28%
36-60	-		1.57%	1.20%	1.28%
61-90	1.54%		1.56%	1.37%	1.43%
91-180	-		1.74%	1.27%	1.57%
>180	1.97%		1.92%	1.88%	1.94%
Total	1.43%		1.41%	1.15%	1.30%

^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	19 – 23 abr.				26 - 30 abr.				03 - 07 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	27	117	5598	5835	45	140	3511	4040	25	96	3633	3405
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3295	2608	0	0	2415	1330	0	0	2120	1183
Otros ^c	117	27	715	1139	140	45	642	1180	96	25	331	1479
Total	144	144	9608	9582	185	185	6568	6550	121	121	6084	6067

^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.