

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de abril de 2021
Fecha de Información: 21 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\$1819 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.38%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	507,9	283,7	193,9	418,3	31,8	31,5	58,0
15-35	387,6	582,5	384,5	160,5	30,4	59,5	167,6
36-60	17,0	10,8	0,0	0,0	10,8	17,0	0,0
61-90	69,2	15,1	0,0	50,0	10,1	14,2	5,0
91-180	66,1	105,6	70,0	5,0	23,1	48,6	12,6
>180	8,4	15,3	4,0	0,0	4,2	1,4	7,1
Total	1056,2	1013,1	652,4	633,8	110,5	172,1	250,2

^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	1.47%		1.29%	1.27%	1.29%
15-35	1.44%		1.46%	1.32%	1.42%
36-60	-		1.69%	1.32%	1.46%
61-90	1.51%		1.74%	1.31%	1.49%
91-180	1.49%		1.63%	1.50%	1.55%
>180	1.84%		1.91%	1.67%	1.86%
Total	1.46%		1.43%	1.30%	1.38%

^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	108	5073	5118	46	139	3684	4271	25	95	3673	3419
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2837	2495	0	0	2597	1431	0	0	2120	1210
Otros ^c	108	27	615	888	139	46	645	1208	95	25	334	1482
Total	135	135	8525	8501	185	185	6926	6910	120	120	6127	6111

^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.