

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de marzo de 2021
Fecha de Información: 02 de marzo 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\$2060 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.78%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 454,7 | 436,1 | 244,2 | 217,9 | 8,5 | 53,4 | 183,4 |
| 15-35 | 646,0 | 681,0 | 343,0 | 275,0 | 60,0 | 93,0 | 277,9 |
| 36-60 | 35,0 | 107,2 | 46,9 | 0,0 | 34,3 | 9,0 | 26,0 |
| 61-90 | 22,2 | 24,7 | 0,0 | 0,0 | 24,3 | 21,9 | 0,4 |
| 91-180 | 26,8 | 81,9 | 55,0 | 0,0 | 3,4 | 3,3 | 23,5 |
| >180 | 49,3 | 16,2 | 5,0 | 25,0 | 1,2 | 14,3 | 10,0 |
| Total | 1234,1 | 1347,1 | 694,1 | 517,9 | 131,7 | 194,9 | 521,2 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 0.69% | | 0.51% | 0.47% | 0.55% |
| 15-35 | 0.79% | | 0.84% | 0.73% | 0.79% |
| 36-60 | 0.85% | | 0.99% | 0.88% | 0.95% |
| 61-90 | 1.22% | | 1.37% | 1.07% | 1.23% |
| 91-180 | 1.42% | | 1.44% | 1.01% | 1.41% |
| >180 | 1.83% | | 2.04% | 1.57% | 1.71% |
| Total | 0.81% | | 0.86% | 0.67% | 0.78% |

^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.

¹ A 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.

² El 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 | 01 – 05 mar. | | | | 08 - 12 mar. | | | | 15 - 19 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 24 | 98 | 4566 | 3941 | 32 | 96 | 4640 | 3975 | 23 | 129 | 6178 | 5934 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 1 | 2024 | 2205 | 0 | 0 | 2316 | 2025 | 0 | 0 | 3213 | 2507 |
| Otros ^c | 98 | 24 | 322 | 739 | 96 | 32 | 456 | 1009 | 129 | 23 | 1219 | 2153 |
| Total | 122 | 123 | 6912 | 6885 | 128 | 128 | 7412 | 7009 | 152 | 152 | 10610 | 10594 |

^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.