

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de marzo de 2021
Fecha de Información: 05 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\$1781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.73%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	288,6	258,3	77,0	154,0	74,8	0,0	134,6
15-35	489,8	458,4	358,7	405,9	23,7	7,9	76,0
36-60	58,0	18,6	0,0	50,0	18,6	8,0	0,0
61-90	52,9	35,9	0,0	0,0	35,9	52,9	0,0
91-180	112,5	151,2	61,0	0,0	10,2	32,5	80,0
>180	86,5	60,6	58,2	78,2	2,3	8,3	0,0
Total	1088,2	982,9	554,9	688,1	165,5	109,5	290,6

^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	0.23%	0.61%	0.62%	0.51%
15-35	0.56%	0.61%	0.57%	0.59%
36-60	—	1.26%	1.35%	1.29%
61-90	—	1.29%	1.00%	1.12%
91-180	1.21%	1.46%	1.25%	1.30%
>180	—	1.95%	1.53%	1.58%
Total	0.62%	0.77%	0.73%	0.73%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	8	22	985	902	34	103	5437	4442	25	131	6776	6402
Intragrupo y off-shore ^b	0	1	388	439	0	0	2414	2493	0	0	3468	2893
Otros ^c	22	7	126	158	102	34	524	1038	131	25	1254	2187
Total	30	30	1499	1499	136	137	8375	7973	156	156	11498	11482

^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.