

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2021
Fecha de Información: 10 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\$3520 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.55%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	382,6	634,3	185,8	300,5	396,5	30,1	52,0
15-35	712,1	1124,9	665,4	343,4	115,0	24,2	344,5
36-60	6,7	26,2	0,0	1,0	26,2	5,7	0,0
61-90	830,3	88,0	0,0	385,0	28,0	385,3	60,0
91-180	3,4	119,5	75,0	0,0	44,5	3,4	0,0
>180	22,4	45,7	10,0	0,0	16,4	3,0	19,3
Total	1957,4	2038,7	936,2	1029,9	626,7	451,7	475,9

^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	0.50%		0.56%	0.35%	0.49%
15-35	0.17%		0.39%	0.17%	0.25%
36-60	–		1.05%	0.60%	0.97%
61-90	0.89%		1.27%	0.86%	0.89%
91-180	–		1.43%	1.17%	1.42%
>180	1.73%		1.82%	1.89%	1.79%
Total	0.36%		0.66%	0.52%	0.55%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(365/Plazo)} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	08 - 12 mar.				15 - 19 mar.				22 - 26 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	30	85	4226	3456	27	140	7479	7828	31	106	2800	1973
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1607	1706	0	0	3704	3343	0	0	836	849
Otros ^c	85	30	465	747	140	27	2267	2263	106	31	647	1459
Total	115	115	6298	5909	167	167	13450	13434	137	137	4283	4281

^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.