

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2021
Fecha de Información: 11 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\$2295 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.58%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	366,4	216,5	92,6	207,1	12,9	48,3	111,0
15-35	752,4	966,4	482,8	309,1	61,6	21,3	422,0
36-60	5,3	33,3	18,3	0,0	15,0	5,3	0,0
61-90	75,9	64,7	0,0	10,0	44,7	45,9	20,0
91-180	86,2	86,2	43,0	0,0	22,9	66,0	20,2
>180	120,6	169,4	80,0	45,0	14,0	0,1	75,5
Total	1406,7	1536,5	716,7	571,2	171,2	186,9	648,7

^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	0.32%	0.35%	0.22%	0.28%
15-35	0.30%	0.39%	0.19%	0.29%
36-60	—	1.05%	0.31%	0.86%
61-90	1.08%	1.31%	0.91%	1.10%
91-180	1.17%	1.44%	1.14%	1.26%
>180	1.73%	1.92%	1.54%	1.74%
Total	0.52%	0.77%	0.48%	0.58%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	22	60	2175	2100	27	129	7748	8023	31	104	2877	1976
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1080	1116	0	0	3795	3513	0	0	836	902
Otros ^c	60	22	312	351	129	27	2273	2265	104	31	650	1484
Total	82	82	3567	3567	156	156	13816	13801	135	135	4363	4362

^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.