

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2021
Fecha de Información: 12 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\$4375 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.57%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 | 928,8 | 1347,1 | 509,8 | 719,3 | 749,2 | 121,4 | 88,1 |
| 15-35 | 445,1 | 479,3 | 326,7 | 306,4 | 82,7 | 68,7 | 70,0 |
| 36-60 | 194,5 | 14,4 | 0,2 | 0,0 | 13,8 | 194,2 | 0,3 |
| 61-90 | 92,9 | 15,0 | 0,0 | 9,6 | 15,0 | 83,3 | 0,0 |
| 91-180 | 602,4 | 414,2 | 311,0 | 100,0 | 68,2 | 467,4 | 35,0 |
| >180 | 7,5 | 27,8 | 20,0 | 0,0 | 7,4 | 7,1 | 0,4 |
| Total | 2271,2 | 2297,8 | 1167,7 | 1135,3 | 936,3 | 942,1 | 193,8 |

^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 | 0.42% | 0.27% | 0.22% | 0.26% |
| 15-35 | 0.40% | 0.40% | 0.32% | 0.37% |
| 36-60 | 0.84% | 1.13% | 0.80% | 0.82% |
| 61-90 | — | 1.26% | 1.00% | 1.04% |
| 91-180 | 1.25% | 1.25% | 1.19% | 1.21% |
| >180 | 1.46% | 1.81% | 1.14% | 1.48% |
| Total | 0.57% | 0.48% | 0.65% | 0.57% |

^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 | 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 | 7 | 38 | 957 | 929 | 28 | 132 | 8487 | 9280 | 32 | 105 | 3006 | 2055 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 528 | 575 | 0 | 0 | 4245 | 4073 | 0 | 0 | 880 | 1002 |
| Otros ^c | 38 | 7 | 97 | 78 | 132 | 28 | 3000 | 2363 | 105 | 32 | 675 | 1503 |
| Total | 45 | 45 | 1582 | 1582 | 160 | 160 | 15732 | 15716 | 137 | 137 | 4561 | 4560 |

^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.