

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2021
Fecha de Información: 26 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\$2489 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.56%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	529,2	257,2	56,0	440,3	137,2	24,9	64,0
15-35	426,7	980,2	727,4	161,6	23,4	35,7	229,4
36-60	130,0	12,6	4,3	4,5	8,3	125,5	0,0
61-90	46,4	104,0	25,0	10,0	69,0	26,4	10,1
91-180	67,0	106,0	0,0	0,5	45,8	6,3	60,3
>180	156,2	77,3	32,0	112,2	5,3	4,0	40,0
Total	1355,6	1537,4	844,7	729,1	288,9	222,7	403,7

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	0.40%		0.60%	0.40%	0.45%
15-35	0.34%		0.46%	0.36%	0.42%
36-60	—		0.71%	0.62%	0.62%
61-90	0.69%		1.01%	0.92%	0.96%
91-180	1.29%		1.39%	1.03%	1.31%
>180	1.47%		1.70%	1.61%	1.55%
Total	0.61%		0.60%	0.48%	0.56%

^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	22 – 26 mar.				29 mar. - 02 abr.				05 - 09 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	21	32	852	930	24	98	5730	5660	53	188	5307	5432
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	184	120	2	0	2986	2794	0	0	2954	2761
Otros ^c	32	21	607	594	96	23	617	879	188	53	603	663
Total	53	53	1643	1644	122	121	9333	9333	241	241	8864	8856

^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.