

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2021
Fecha de Información: 29 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\$1985 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.22%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	463,5	196,2	159,7	368,8	7,5	65,7	29
15-35	525,0	882,5	567,4	216,3	70,0	63,7	245
36-60	45,7	28,9	0,0	0,0	23,9	40,7	5
61-90	2,2	19,6	16,5	0,2	3,1	2,0	0
91-180	68,8	38,2	0,0	10,0	8,2	28,8	30
>180	18,2	18,0	0,0	0,0	5,0	5,2	13
Total	1123,5	1183,5	743,6	595,4	117,8	206,1	322

^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	0.18%		0.14%	0.10%	0.11%
15-35	0.16%		0.18%	0.13%	0.17%
36-60	0.72%		0.39%	0.29%	0.36%
61-90	—		1.00%	0.59%	0.96%
91-180	1.03%		1.39%	0.92%	1.03%
>180	1.56%		1.85%	1.32%	1.57%
Total	0.31%		0.23%	0.16%	0.22%

^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: ((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	29 mar. - 02 abr.				05 - 09 abr.				12 - 16 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	24	103	5862	5852	60	188	5649	5478	45	113	4455	5084
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	3136	2890	0	0	2989	3042	0	0	3104	1796
Otros ^c	101	24	629	886	188	60	603	712	113	45	647	1312
Total	127	127	9627	9628	248	248	9241	9232	158	158	8206	8192

^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.