

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de abril de 2021
Fecha de Información: 07 de abril 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\$1570 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.51%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 | 258,4 | 341,2 | 217,5 | 156,6 | 71,8 | 49,8 | 52,0 |
| 15-35 | 358,1 | 506,5 | 306,8 | 168,6 | 53,3 | 42,9 | 146,5 |
| 36-60 | 77,7 | 56,3 | 1,1 | 20,0 | 35,1 | 37,7 | 20,1 |
| 61-90 | 24,2 | 32,8 | 0,0 | 1,6 | 32,7 | 22,5 | 0,1 |
| 91-180 | 33,6 | 48,7 | 0,0 | 0,0 | 18,6 | 3,5 | 30,1 |
| >180 | 74,8 | 76,9 | 0,0 | 0,0 | 6,5 | 4,4 | 70,4 |
| Total | 826,8 | 1062,5 | 525,3 | 346,8 | 218,0 | 160,9 | 319,1 |

^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 | 0.63% | | 0.76% | -2.49% | -0.74% |
| 15-35 | 0.85% | | 0.87% | 0.92% | 0.87% |
| 36-60 | 1.33% | | 1.09% | 0.95% | 1.06% |
| 61-90 | 1.12% | | 1.68% | 1.46% | 1.59% |
| 91-180 | 1.59% | | 1.67% | 1.43% | 1.61% |
| >180 | 1.67% | | 1.64% | 0.97% | 1.63% |
| Total | 1.10% | | 0.94% | -0.63% | 0.51% |

^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 | 05 – 09 abr. | | | | 12 - 16 abr. | | | | 19 - 23 abr. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 26 | 164 | 4536 | 4467 | 48 | 116 | 5258 | 5652 | 21 | 125 | 4044 | 4419 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2338 | 2477 | 0 | 0 | 3348 | 2332 | 0 | 0 | 2651 | 1801 |
| Otros ^c | 164 | 26 | 514 | 443 | 116 | 48 | 732 | 1333 | 125 | 21 | 431 | 881 |
| Total | 190 | 190 | 7388 | 7387 | 164 | 164 | 9338 | 9317 | 146 | 146 | 7126 | 7101 |

^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.