

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2021
Fecha de Información: 08 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\$1987 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.16%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	355,5	491,8	208,0	184,4	135,3	22,6	148,5
15-35	517,2	484,2	242,2	265,7	19,7	29,2	222,3
36-60	1,8	132,6	100,0	0,0	32,6	1,8	0,0
61-90	102,1	8,0	0,3	0,0	7,7	102,1	0,0
91-180	52,2	146,1	50,0	0,0	46,1	2,2	50,0
>180	62,2	110,4	52,0	0,0	2,4	6,2	56,0
Total	1090,9	1373,2	652,5	450,1	243,8	163,9	476,8

^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	1.10%		1.05%	0.96%	1.04%
15-35	1.17%		1.14%	1.04%	1.12%
36-60	—		1.28%	1.04%	1.26%
61-90	—		1.57%	1.29%	1.31%
91-180	1.57%		1.69%	0.95%	1.61%
>180	1.72%		2.25%	1.31%	1.70%
Total	1.25%		1.15%	1.07%	1.16%

^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	17	126	3399	3470	48	120	5513	5963	21	125	4092	4492
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1816	1746	0	0	3426	2461	0	0	2686	1813
Otros ^c	126	17	313	310	120	48	857	1351	125	21	433	882
Total	143	143	5528	5526	168	168	9796	9775	146	146	7211	7187

^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.