

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2021
Fecha de Información: 14 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\$4816 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.40%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	1635,0	1146,7	356,1	983,2	601,8	463,0	188,8
15-35	571,2	1223,8	933,5	264,5	5,5	21,9	284,8
36-60	31,8	45,5	11,5	0,0	34,0	31,8	0,0
61-90	8,3	65,5	29,3	0,0	36,2	8,3	0,0
91-180	368,7	206,5	60,0	61,5	36,5	197,2	110,0
>180	53,8	64,7	40,0	30,0	3,1	2,3	21,5
Total	2668,8	2752,6	1430,4	1339,2	717,1	724,5	605,2

^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	1.45%		1.34%	1.30%	1.33%
15-35	1.45%		1.43%	1.43%	1.44%
36-60	—		1.63%	1.34%	1.51%
61-90	—		1.85%	1.43%	1.77%
91-180	1.59%		1.64%	1.48%	1.54%
>180	1.71%		1.89%	1.71%	1.74%
Total	1.48%		1.41%	1.35%	1.40%

^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	12 – 16 abr.				19 - 23 abr.				26 - 30 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	30	104	5276	5779	26	129	4871	5117	41	121	2693	3704
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2841	2688	0	0	3038	2183	0	0	2254	974
Otros ^c	104	30	1440	1076	129	26	558	1142	121	41	589	839
Total	134	134	9557	9543	155	155	8467	8442	162	162	5536	5517

^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.