

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2021
Fecha de Información: 22 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\$2853 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.49%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	478,0	410,6	270,8	317,9	11,3	31,6	128,5
15-35	896,3	1239,1	643,0	295,8	19,6	24,0	576,5
36-60	11,6	31,3	15,0	3,0	16,3	8,6	0,0
61-90	145,7	52,7	0,0	50,0	32,4	75,4	20,3
91-180	85,1	95,2	50,0	60,1	35,2	15,0	10,0
>180	111,5	134,8	25,0	0,0	6,0	7,7	103,8
Total	1728,1	1963,7	1003,8	726,8	120,9	162,3	839,0

^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	1.52%		1.04%	1.19%	1.23%
15-35	1.55%		1.55%	1.50%	1.54%
36-60	—		1.66%	1.41%	1.59%
61-90	1.60%		1.73%	1.38%	1.47%
91-180	1.61%		1.79%	1.45%	1.56%
>180	1.96%		1.98%	1.83%	1.95%
Total	1.60%		1.48%	1.35%	1.49%

^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	19 – 23 abr.				26 - 30 abr.				03 - 07 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	16	69	3535	3736	48	139	3885	4384	25	96	3691	3468
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2177	1836	0	0	2692	1608	0	0	2167	1210
Otros ^c	69	16	259	379	139	48	650	1217	96	25	335	1500
Total	85	85	5971	5951	187	187	7227	7209	121	121	6193	6178

^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.