

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2021
Fecha de Información: 26 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\$1882 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.50%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	428,8	470,8	261,7	321,7	115,6	13,6	93,5
15-35	382,9	557,8	445,4	91,6	16,8	195,7	95,6
36-60	16,6	6,1	0,0	6,7	6,0	9,8	0,2
61-90	12,5	27,0	0,0	0,0	27,0	12,5	0,0
91-180	55,7	13,0	0,0	10,0	11,8	44,5	1,2
>180	75,2	60,8	25,0	30,0	0,8	10,2	35,0
Total	971,8	1135,5	732,1	460,0	177,9	286,3	225,5

^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	1.63%	1.04%	1.29%	1.23%
15-35	1.73%	1.69%	1.52%	1.63%
36-60	1.62%	1.76%	1.47%	1.58%
61-90	—	1.71%	1.59%	1.67%
91-180	1.52%	1.72%	1.63%	1.65%
>180	1.91%	2.10%	2.06%	1.99%
Total	1.72%	1.45%	1.47%	1.50%

^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	26 – 30 abr.				03 - 07 may.				10 - 14 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	56	151	4538	4939	29	96	3991	3796	39	121	5568	5235
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3008	2139	0	0	2316	1337	0	0	2929	1917
Otros ^c	151	56	789	1238	96	29	345	1503	121	39	612	1952
Total	207	207	8335	8316	125	125	6652	6636	160	160	9109	9104

^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.