

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2021
Fecha de Información: 28 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\$1791 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.73%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	309,7	330,3	129,0	172,5	77,9	13,7	123,5
15-35	399,8	525,5	395,2	236,5	7,8	40,9	122,5
36-60	24,8	27,7	1,3	0,6	9,3	7,0	17,2
61-90	164,6	88,5	0,6	1,9	22,8	97,7	65,0
91-180	92,8	110,8	30,0	0,0	19,0	31,0	61,8
>180	88,5	20,7	0,0	80,1	18,2	5,9	2,5
Total	1080,2	1103,5	556,1	491,6	155,0	196,1	392,5

^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	1.74%	1.77%	1.65%	1.73%
15-35	1.76%	1.83%	1.66%	1.74%
36-60	1.74%	2.14%	1.50%	1.80%
61-90	1.75%	1.81%	1.59%	1.67%
91-180	1.75%	1.84%	1.62%	1.74%
>180	2.07%	1.89%	1.76%	1.87%
Total	1.75%	1.82%	1.64%	1.73%

^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	28	124	3141	3372	37	97	4166	4123	47	124	5642	5342
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1882	1473	0	0	2482	1404	0	0	3023	1965
Otros ^c	124	28	585	745	97	37	428	1523	124	47	615	1958
Total	152	152	5608	5590	134	134	7076	7050	171	171	9280	9265

^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.