INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de marzo de 2021
Fecha de Información: 04 de marzo de 2021[1]

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$2685 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.07%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	540,1	438,6	269,4	440,1	87,3	18,0	82,0
15-35	587,6	630,9	397,0	362,4	19,9	11,2	214,0
36-60	10,9	20,4	0,3	0,0	19,5	10,3	0,6
61-90	239,2	79,4	35,9	113,0	23,5	106,2	20,0
91-180	136,3	313,1	277,0	21,1	20,9	99,9	15,3
>180	10,0	10,5	5,0	4,6	5,5	5,4	0,0
Total	**1524,1**	**1492,8**	**984,5**	**941,2**	**176,4**	**251,0**	**331,9**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	0.55%	0.87%	0.62%	0.71%
15-35	2.41%	0.78%	0.86%	1.25%
36-60	0.81%	1.17%	0.69%	1.00%
61-90	1.22%	1.27%	0.93%	1.04%
91-180	1.32%	1.33%	1.29%	1.31%
>180	–	1.87%	1.47%	1.68%
Total	**1.82%**	**0.99%**	**0.84%**	**1.07%**

[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: ((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

	01 – 05 mar.				08 - 12 mar.				15 - 19 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	13	76	2008	1933	32	97	5203	4159	23	131	6666	6347
Intragrupo y off-shore[b]	0	1	1020	890	0	0	2336	2383	0	0	3453	2830
Otros[c]	76	12	219	420	97	32	458	1052	131	23	1248	2174
Total	**89**	**89**	**3247**	**3243**	**129**	**129**	**7997**	**7594**	**154**	**154**	**11367**	**11351**

[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.