INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2021
Fecha de Información: 08 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$2684 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.70%[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	557,0	884,4	133,8	132,5	347,2	21,0	403,5
15-35	504,6	519,7	267,0	271,0	37,7	18,6	215,0
36-60	86,5	9,3	0,0	0,0	9,3	86,5	0,0
61-90	228,0	42,9	20,6	0,0	22,3	228,0	0,0
91-180	343,5	358,2	10,0	10,0	53,9	39,2	294,3
>180	21,0	41,8	35,0	10,0	6,8	11,0	0,0
Total	**1740,6**	**1856,3**	**466,4**	**423,5**	**477,1**	**404,3**	**912,8**

[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	0.52%	0.36%	0.17%	0.40%
15-35	0.50%	0.63%	0.44%	0.53%
36-60	–	1.31%	0.96%	0.99%
61-90	–	1.16%	0.96%	0.98%
91-180	1.21%	1.35%	1.24%	1.23%
>180	–	2.13%	1.54%	1.84%
Total	**0.73%**	**0.61%**	**0.75%**	**0.70%**

[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

	08 – 12 mar.				15 - 19 mar.				22 - 26 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	37	108	5893	4858	26	132	7000	6898	30	101	2738	1872
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2518	2687	0	0	3574	3003	0	0	755	839
Otros[c]	108	37	574	1037	132	26	1547	2205	101	30	633	1414
Total	**145**	**145**	**8985**	**8582**	**158**	**158**	**12121**	**12106**	**131**	**131**	**4126**	**4125**

[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.