INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2021
Fecha de Información: 23 de abril 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$2173 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.56%[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	477,9	354,1	229,9	343,8	11,2	21,1	113
15-35	547,3	936,0	615,5	222,7	19,4	23,6	301
36-60	15,8	16,2	14,0	0,0	2,2	15,8	0
61-90	25,1	34,5	0,0	0,0	34,5	25,1	0
91-180	47,5	42,9	10,0	0,0	12,9	27,5	20
>180	108,9	50,5	0,0	55,0	0,5	3,9	50
Total	**1222,5**	**1434,2**	**869,4**	**621,5**	**80,8**	**117,0**	**484**

[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	1.60%	1.48%	1.40%	1.46%
15-35	1.64%	1.49%	1.62%	1.56%
36-60	–	1.68%	1.53%	1.60%
61-90	–	1.74%	1.57%	1.67%
91-180	1.64%	1.79%	1.56%	1.66%
>180	2.07%	2.28%	2.06%	2.07%
Total	**1.68%**	**1.51%**	**1.54%**	**1.56%**

[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

	19 – 23 abr.				26 - 30 abr.				03 - 07 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	3	36	693	698	51	145	4218	4563	26	96	3831	3653
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	294	243	0	0	2826	1891	0	0	2273	1271
Otros[c]	36	3	165	201	145	51	660	1232	96	26	336	1500
Total	**39**	**39**	**1152**	**1142**	**196**	**196**	**7704**	**7686**	**122**	**122**	**6440**	**6424**

[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.