INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2021
Fecha de Información: 27 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$1708 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.71%[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	248,2	298,0	180,7	112,4	12,2	30,9	105,0
15-35	390,7	598,3	423,6	178,9	19,7	56,8	155,0
36-60	13,2	72,6	70,0	0,0	2,6	13,2	0,0
61-90	41,3	99,5	35,0	0,0	64,5	41,3	0,0
91-180	133,3	130,2	10,0	0,3	5,2	18,0	115,0
>180	41,2	18,1	10,0	20,0	6,6	19,7	1,5
Total	**867,8**	**1216,8**	**729,3**	**311,5**	**111,0**	**179,8**	**376,5**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	1.90%	1.58%	1.33%	1.59%
15-35	1.78%	1.82%	1.66%	1.77%
36-60	–	1.79%	1.36%	1.57%
61-90	–	1.76%	1.63%	1.71%
91-180	1.74%	1.96%	1.47%	1.72%
>180	1.72%	1.89%	1.88%	1.88%
Total	**1.80%**	**1.76%**	**1.53%**	**1.71%**

[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

	26 – 30 abr.				03 - 07 may.				10 - 14 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	40	143	4268	4554	32	97	4058	3874	41	126	5580	5274
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2759	1996	0	0	2370	1361	0	0	2956	1917
Otros[c]	143	40	751	1212	97	32	351	1518	126	41	614	1954
Total	**183**	**183**	**7778**	**7762**	**129**	**129**	**6779**	**6753**	**167**	**167**	**9150**	**9145**

[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.