INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de mayo de 2021
Fecha de Información: 29 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$1621 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.65%[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	287,8	138,5	100,9	240,8	15,7	25,1	21,9
15-35	392,3	665,2	471,6	101,5	55,9	153,1	137,7
36-60	17,7	17,8	1,0	1,0	16,8	16,7	0,0
61-90	36,5	56,8	13,9	0,0	42,4	36,0	0,5
91-180	65,8	78,3	10,0	7,4	17,3	7,4	51,0
>180	74,3	61,4	0,0	5,0	1,0	8,9	60,4
Total	**874,5**	**1017,9**	**597,4**	**355,7**	**149,1**	**247,3**	**271,5**

[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	1.75%	1.58%	1.20%	1.31%
15-35	1.72%	1.76%	1.62%	1.71%
36-60	–	1.88%	1.60%	1.74%
61-90	1.58%	1.84%	1.62%	1.76%
91-180	1.82%	1.93%	1.50%	1.78%
>180	2.13%	2.11%	1.70%	2.05%
Total	**1.83%**	**1.76%**	**1.43%**	**1.65%**

[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]	17	62	1366	1471	45	98	4241	4281	48	127	5660	5465
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	582	514	0	0	2629	1462	0	0	3131	1965
Otros[c]	62	17	477	424	98	45	430	1531	127	48	620	1966
Total	**79**	**79**	**2425**	**2409**	**143**	**143**	**7300**	**7274**	**175**	**175**	**9411**	**9396**

[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.