INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de mayo de 2021
Fecha de Información: 30 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$2052 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	298,6	452,7	329,3	176,2	27,4	26,5	96,0
15-35	374,8	802,6	649,9	230,1	60,8	52,8	92,0
36-60	15,6	12,6	3,8	0,0	8,8	15,6	0,0
61-90	73,8	28,2	0,0	20,0	8,2	33,8	20,0
91-180	82,1	55,4	0,1	0,0	30,3	57,1	25,0
>180	83,3	46,3	0,0	15,2	5,6	27,3	40,7
Total	**928,3**	**1397,8**	**983,0**	**441,4**	**141,1**	**213,1**	**273,7**

[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	1.84%	1.65%	1.56%	1.66%
15-35	1.81%	1.83%	1.71%	1.80%
36-60	–	1.92%	1.54%	1.68%
61-90	1.80%	1.94%	1.49%	1.65%
91-180	1.78%	1.30%	0.96%	1.24%
>180	2.12%	1.88%	1.75%	1.93%
Total	**1.86%**	**1.76%**	**1.56%**	**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]	8	28	477	448	47	101	4452	4472	49	127	5710	5646
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	237	256	0	0	2734	1601	0	0	3284	1973
Otros[c]	28	8	83	82	101	47	451	1537	127	49	624	1985
Total	**36**	**36**	**797**	**786**	**148**	**148**	**7637**	**7610**	**176**	**176**	**9618**	**9604**

[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.