INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de mayo de 2021
Fecha de Información: 03 de mayo 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$1256 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.89%[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	81,4	117,8	67,2	37,2	24,6	18,2	26,0
15-35	358,0	569,7	357,8	164,5	35,4	17,0	176,5
36-60	36,1	62,2	15,0	1,9	36,7	23,7	10,5
61-90	14,9	31,0	6,0	0,0	25,0	14,9	0,0
91-180	68,2	93,7	43,0	12,2	9,2	14,4	41,5
>180	59,5	26,8	15,0	36,1	2,9	14,5	8,9
Total	**618,1**	**901,2**	**504,0**	**251,9**	**133,7**	**102,8**	**263,4**

[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%	1.82%	1.75%	1.81%
15-35	1.90%	1.94%	1.74%	1.90%
36-60	1.81%	2.45%	1.66%	2.08%
61-90	–	1.95%	1.63%	1.83%
91-180	1.79%	2.00%	1.47%	1.74%
>180	1.75%	2.12%	1.92%	1.94%
Total	**1.88%**	**1.97%**	**1.75%**	**1.89%**

[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

	03 – 07 may.				10 - 14 may.				17 - 21 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	47	106	4520	4620	50	125	5760	5677	16	110	3415	3652
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2855	1640	0	0	3284	2003	0	0	2283	898
Otros[c]	106	47	461	1551	125	50	639	1989	110	16	398	1533
Total	**153**	**153**	**7836**	**7811**	**175**	**175**	**9683**	**9669**	**126**	**126**	**6096**	**6083**

[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.