INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2021
Fecha de Información: 07 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$2792 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	309,4	889,4	469,6	97,0	280,8	73,4	139,0
15-35	861,3	405,3	94,2	582,6	82,3	49,9	228,7
36-60	34,4	71,9	0,0	0,0	51,9	14,4	20,0
61-90	420,9	220,7	44,1	0,0	16,5	260,9	160,0
91-180	81,0	52,6	6,1	16,0	16,4	35,0	30,0
>180	4,3	18,3	5,1	0,0	13,2	4,3	0,0
Total	**1711,3**	**1658,1**	**619,3**	**695,6**	**461,1**	**438,0**	**577,8**

[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	1.68%	1.69%	0.68%	1.56%
15-35	1.68%	1.72%	1.61%	1.66%
36-60	1.76%	1.88%	1.48%	1.79%
61-90	1.82%	1.83%	1.61%	1.70%
91-180	1.74%	2.00%	1.62%	1.72%
>180	–	2.11%	1.85%	2.05%
Total	**1.72%**	**1.73%**	**1.49%**	**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

	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]	5	23	628	648	97	135	6329	7024	18	112	3594	3941
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	462	184	0	0	3938	2150	0	0	2464	915
Otros[c]	23	5	40	288	135	97	1005	2082	112	18	420	1602
Total	**28**	**28**	**1130**	**1120**	**232**	**232**	**11272**	**11256**	**130**	**130**	**6478**	**6458**

[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.