

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de mayo de 2021
Fecha de Información: 04 de mayo de 2021¹

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\$2436 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.84%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	309,3	522,4	344,3	147,5	77,2	60,8	101,0
15-35	436,3	738,3	501,0	123,5	26,3	101,8	211,0
36-60	193,6	227,0	0,0	52,0	152,0	66,6	75,0
61-90	231,6	2,9	0,0	23,0	2,9	208,6	0,0
91-180	58,9	83,9	10,6	0,0	18,3	3,9	55,0
>180	36,1	58,1	6,0	0,0	31,9	15,9	20,2
Total	1265,8	1632,6	861,9	346,0	308,6	457,6	462,2

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.93%		1.88%	1.43%	1.75%
15-35	1.91%		1.96%	1.80%	1.91%
36-60	1.73%		1.90%	1.81%	1.84%
61-90	—		2.33%	1.69%	1.70%
91-180	1.80%		2.00%	1.42%	1.85%
>180	1.89%		2.17%	1.81%	2.02%
Total	1.87%		1.95%	1.68%	1.84%

^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.

¹A 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.

²El 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

Sectores	03 – 07 may.				10 - 14 may.				17 - 21 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	83	3626	3552	55	125	5855	5939	16	111	3467	3736
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2092	1243	0	0	3412	2003	0	0	2359	903
Otros ^c	83	31	391	1292	125	55	684	1993	111	16	401	1576
Total	114	114	6109	6087	180	180	9951	9935	127	127	6227	6215

^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.