

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de mayo de 2021
Fecha de Información: 05 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\$2799 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.81%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	468,2	276,7	66,0	215,2	45,1	87,5	165,5
15-35	552,4	842,6	495,6	185,8	25,6	45,1	321,5
36-60	22,4	413,6	25,0	2,0	388,6	20,4	0,0
61-90	6,4	1,7	0,0	0,0	1,2	5,9	0,5
91-180	511,4	135,8	57,6	83,7	8,2	357,7	70,0
>180	75,7	72,9	47,6	34,5	2,3	18,2	23,0
Total	1636,5	1743,2	691,7	521,2	471,0	534,8	580,5

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.89%	1.87%	1.68%	1.77%
15-35	1.82%	1.90%	1.81%	1.85%
36-60	—	1.88%	1.67%	1.87%
61-90	1.59%	1.95%	1.58%	1.64%
91-180	1.75%	1.77%	1.68%	1.70%
>180	2.07%	1.97%	2.20%	2.08%
Total	1.84%	1.88%	1.72%	1.81%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	29	76	3383	3142	93	125	5964	6049	17	111	3482	3803
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1799	1106	0	0	3417	2032	0	0	2421	910
Otros ^c	76	29	312	1223	125	93	719	2005	111	17	406	1584
Total	105	105	5494	5471	218	218	10100	10086	128	128	6309	6297

^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.