

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2021
Fecha de Información: 06 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\$2690 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.76%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	240,9	407,7	237,6	65,0	24,1	29,9	146,0
15-35	856,2	664,9	123,1	306,5	109,9	117,7	432,0
36-60	15,1	307,0	23,6	6,3	283,4	8,7	0,0
61-90	55,4	25,0	0,0	40,0	25,0	15,4	0,0
91-180	420,6	263,4	115,2	0,0	13,0	285,4	135,2
>180	127,2	100,3	2,6	25,0	17,7	22,2	80,0
Total	1715,3	1768,4	502,1	442,8	473,1	479,3	793,2

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.78%	1.58%	1.80%	1.71%
15-35	1.76%	1.86%	1.68%	1.76%
36-60	—	1.85%	1.64%	1.85%
61-90	—	1.94%	1.60%	1.81%
91-180	1.71%	1.77%	1.65%	1.68%
>180	1.89%	2.19%	1.84%	1.92%
Total	1.77%	1.81%	1.69%	1.76%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$. 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	11	47	2907	2811	96	127	6110	6438	18	111	3554	3898
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1641	856	0	0	3686	2058	0	0	2454	910
Otros ^c	47	11	258	1123	127	96	731	2017	111	18	418	1596
Total	58	58	4806	4790	223	223	10527	10513	129	129	6426	6404

^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.