

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2021
Fecha de Información: 10 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\$1384 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.67%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	329,9	162,7	75,0	221,8	20,2	40,5	67,5
15-35	413,3	551,6	254,7	197,3	104,4	23,5	192,5
36-60	18,2	38,7	0,0	0,0	38,7	18,2	0,0
61-90	22,9	22,7	2,7	0,0	20,1	22,9	0,0
91-180	3,3	35,4	2,7	0,0	32,7	3,3	0,0
>180	11,3	35,5	20,3	0,0	14,2	10,3	1,0
Total	798,8	846,6	355,4	419,1	230,2	118,7	261,0

^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	1.71%	1.63%	1.56%	1.60%
15-35	1.73%	1.75%	1.37%	1.65%
36-60	—	1.96%	1.66%	1.86%
61-90	—	1.99%	1.56%	1.76%
91-180	—	2.07%	1.50%	2.01%
>180	1.80%	2.15%	1.89%	2.03%
Total	1.72%	1.80%	1.50%	1.67%

^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	10 – 14 may.				17 - 21 may.				24 - 28 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	101	141	6625	7144	23	115	3652	3966	129	193	4286	5125
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4020	2386	0	0	2471	953	0	0	2879	1418
Otros ^c	141	101	1005	2106	115	23	433	1611	193	129	731	1348
Total	242	242	11650	11636	138	138	6556	6530	322	322	7896	7891

^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.