

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2021
Fecha de Información: 11 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\$1907 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.71%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	455,5	324,9	181,8	346,0	99,0	65,5	44,0
15-35	459,5	449,2	299,9	360,7	61,4	11,0	87,8
36-60	9,1	108,5	60,0	0,0	43,0	3,6	5,5
61-90	0,4	15,6	0,8	0,0	14,9	0,4	0,0
91-180	26,7	72,7	0,0	20,0	72,3	6,3	0,4
>180	55,4	68,2	46,0	40,0	20,8	14,0	1,4
Total	1006,6	1039,0	588,5	766,7	311,3	100,8	139,1

^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	1.69%	1.75%	1.38%	1.54%
15-35	1.73%	1.82%	1.69%	1.76%
36-60	1.77%	2.08%	1.63%	2.03%
61-90	—	1.94%	1.57%	1.93%
91-180	1.72%	1.99%	1.71%	1.91%
>180	1.94%	2.11%	2.24%	2.18%
Total	1.72%	1.85%	1.55%	1.71%

^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	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	102	121	5220	5527	23	121	3757	4086	126	195	4384	5248
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2935	1914	0	0	2536	1037	0	0	2897	1494
Otros ^c	121	102	870	1569	121	23	481	1624	195	126	818	1347
Total	223	223	9025	9010	144	144	6774	6747	321	321	8099	8089

^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.