

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2021
Fecha de Información: 12 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\$2631 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.79%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	581,7	510,9	217,9	392,5	187,5	83,7	105,5
15-35	368,7	833,8	614,7	203,7	80,5	26,5	138,5
36-60	36,2	21,8	5,0	0,7	16,8	35,4	0,0
61-90	281,0	63,6	0,0	35,0	63,6	246,0	0,0
91-180	65,4	3,5	0,0	65,2	3,5	0,2	0,0
>180	93,1	87,3	15,0	17,0	0,4	4,2	71,9
Total	1426,0	1520,9	852,7	714,1	352,3	396,0	315,9

^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	1.61%		1.73%	1.52%	1.61%
15-35	1.77%		1.89%	2.09%	1.90%
36-60	—		1.96%	1.68%	1.77%
61-90	—		1.93%	1.69%	1.73%
91-180	—		2.07%	1.77%	1.79%
>180	2.32%		2.20%	2.34%	2.31%
Total	1.84%		1.85%	1.71%	1.79%

^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	59	119	5043	5198	25	122	3918	4199	126	196	4435	5289
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2667	1968	0	0	2604	1157	0	0	2932	1502
Otros ^c	119	59	978	1506	122	25	491	1631	196	126	823	1390
Total	178	178	8688	8672	147	147	7013	6987	322	322	8190	8181

^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.