

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2021
Fecha de Información: 13 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\$2980 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.65%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	543,2	176,1	106,5	472,7	46,6	47,5	23,0
15-35	463,7	1235,7	659,7	259,8	378,9	7,0	197,0
36-60	23,9	23,8	0,0	0,0	23,4	23,5	0,4
61-90	10,6	50,8	0,0	0,0	50,8	10,6	0,0
91-180	373,5	168,7	130,0	0,0	27,7	362,5	11,0
>180	114,6	112,6	23,0	20,0	4,1	9,1	85,4
Total	1529,6	1767,6	919,2	752,5	531,6	460,2	316,9

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.77%	0.89%	1.13%	1.12%
15-35	1.80%	1.82%	1.60%	1.79%
36-60	1.76%	1.92%	1.67%	1.80%
61-90	—	1.92%	1.64%	1.87%
91-180	1.82%	1.89%	1.70%	1.74%
>180	2.36%	2.26%	2.16%	2.31%
Total	1.95%	1.77%	1.43%	1.65%

^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	45	78	4387	4370	89	125	4129	4240	127	197	4478	5323
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2222	1768	0	0	2642	1346	0	0	2961	1535
Otros ^c	78	45	751	1206	125	89	493	1653	197	127	829	1400
Total	123	123	7360	7344	214	214	7264	7239	324	324	8268	8258

^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.