

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2021
Fecha de Información: 14 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\$2935 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.41%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	482,0	243,4	56,0	367,5	91,1	18,2	96,3
15-35	555,7	903,1	435,7	255,3	294,4	127,4	173,0
36-60	14,3	32,9	0,0	0,0	22,6	4,1	10,2
61-90	2,1	251,5	10,0	0,0	241,5	2,1	0,0
91-180	441,0	184,7	37,2	0,0	107,5	401,0	40,0
>180	127,6	136,6	10,0	0,0	6,6	7,6	120,0
Total	1622,7	1752,2	548,9	622,8	763,8	560,4	439,5

^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	1.76%	1.63%	1.38%	1.49%
15-35	1.77%	1.33%	1.60%	1.46%
36-60	1.87%	2.06%	1.57%	1.95%
61-90	—	0.42%	1.70%	0.43%
91-180	1.80%	2.09%	1.20%	1.42%
>180	2.26%	2.09%	1.79%	2.22%
Total	1.91%	1.27%	1.38%	1.41%

^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	9	36	1480	1477	100	137	4738	4459	127	204	4513	5446
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	869	617	0	0	2692	1833	0	0	3065	1563
Otros ^c	36	9	172	427	137	100	556	1669	204	127	844	1404
Total	45	45	2521	2521	237	237	7986	7961	331	331	8422	8413

^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.