

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2021
Fecha de Información: 24 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\$1403 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.82%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	508,8	107,0	49,0	444,2	10,0	16,7	47,9
15-35	202,8	583,4	451,9	73,9	36,5	33,9	95,0
36-60	15,4	28,2	0,8	0,0	27,4	15,4	0,0
61-90	19,1	27,2	0,0	0,0	27,2	19,1	0,0
91-180	7,4	37,1	20,0	0,0	17,1	7,4	0,0
>180	4,6	5,0	0,0	0,0	5,0	4,6	0,0
Total	758,1	787,8	521,7	518,1	123,2	97,1	142,9

^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	2.04%		2.47%	1.61%	1.72%
15-35	1.89%		1.88%	1.79%	1.87%
36-60	-		1.97%	1.78%	1.90%
61-90	-		2.04%	1.74%	1.92%
91-180	-		2.02%	1.73%	1.97%
>180	-		2.60%	2.35%	2.48%
Total	1.94%		1.95%	1.66%	1.82%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	24 – 28 may.				31 may. - 04 jun.				07 - 11 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	150	256	5616	6180	95	186	2582	3739	22	101	4225	4577
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3407	2327	0	0	2398	1050	0	0	3043	1861
Otros ^c	256	150	977	1484	186	95	389	554	101	22	432	848
Total	406	406	10000	9991	281	281	5369	5343	123	123	7700	7286

^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.