

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2021
Fecha de Información: 25 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\$3299 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.67%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	816,4	815,6	82,4	552,3	495,0	25,9	238,2
15-35	404,4	855,0	533,7	118,6	48,3	12,8	273,0
36-60	47,5	32,6	0,0	0,0	22,6	37,5	10,0
61-90	120,4	56,3	0,0	0,0	36,3	100,4	20,0
91-180	136,7	129,3	35,7	55,0	13,6	1,7	80,0
>180	421,2	130,0	84,5	0,0	0,6	376,2	45,0
Total	1946,6	2018,8	736,2	726,0	616,4	554,4	666,2

^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	1.99%		0.51%	1.90%	1.29%
15-35	1.99%		2.00%	1.87%	1.99%
36-60	1.92%		2.06%	1.92%	1.96%
61-90	2.08%		2.10%	1.86%	1.94%
91-180	2.01%		2.15%	1.92%	2.02%
>180	2.03%		2.30%	2.02%	2.02%
Total	2.00%		1.17%	1.94%	1.67%

^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	144	227	4931	5653	100	187	2723	3817	23	102	4231	4678
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2794	2124	0	0	2448	1183	0	0	3139	1861
Otros ^c	227	144	1340	1278	187	100	411	557	102	23	435	850
Total	371	371	9065	9055	287	287	5582	5557	125	125	7805	7389

^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.