

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2021
Fecha de Información: 26 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\$3914 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.82%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	433,0	321,5	153,4	332,9	95,6	27,6	72,5
15-35	885,6	1508,9	460,4	472,1	666,5	31,5	382,0
36-60	19,0	32,0	5,6	0,4	26,4	18,6	0,0
61-90	1,8	68,8	60,0	0,0	8,8	1,8	0,0
91-180	448,0	316,3	225,0	30,3	6,3	332,7	85,0
>180	388,6	104,9	25,0	10,0	4,9	303,6	75,0
Total	2176,0	2352,4	929,4	845,8	808,5	715,7	614,5

^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	1.98%		1.97%	1.76%	1.89%
15-35	1.97%		1.60%	1.95%	1.76%
36-60	-		2.12%	1.91%	2.03%
61-90	-		-0.00%	1.57%	0.27%
91-180	1.91%		1.91%	1.75%	1.81%
>180	2.13%		2.29%	1.93%	1.99%
Total	1.99%		1.71%	1.85%	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	67	199	3976	4708	102	188	2926	3906	27	103	4355	4880
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2310	1819	0	0	2450	1342	0	0	3194	1951
Otros ^c	199	67	1189	939	188	102	457	560	103	27	566	870
Total	266	266	7475	7466	290	290	5833	5808	130	130	8115	7701

^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.