INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2021
Fecha de Información: 18 de mayo de 2021[1]

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$2563 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.62%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	754,0	460,3	331,0	627,6	66,2	63,3	63,1
15-35	449,4	552,4	387,2	355,3	115,6	44,5	49,6
36-60	32,9	76,7	0,1	0,0	76,6	32,9	0,0
61-90	54,9	75,2	0,0	0,0	33,7	13,4	41,5
91-180	12,7	183,1	100,0	0,0	83,1	12,7	0,0
>180	31,2	64,5	0,7	0,0	33,8	1,2	30,0
Total	**1335,1**	**1412,2**	**819,0**	**982,9**	**409,0**	**168,0**	**184,2**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	1.82%	1.66%	1.27%	1.43%
15-35	1.72%	1.76%	1.63%	1.71%
36-60	–	1.98%	1.61%	1.87%
61-90	1.89%	2.03%	1.68%	1.91%
91-180	–	2.02%	1.56%	1.96%
>180	2.29%	2.49%	1.52%	2.38%
Total	**1.89%**	**1.80%**	**1.38%**	**1.62%**

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

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	17 – 21 may.				24 - 28 may.				31 may. - 04 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	103	149	5183	4569	130	213	4623	5638	89	99	2295	3487
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2788	2213	0	0	3169	1618	0	0	2328	922
Otros[c]	149	103	561	1724	213	130	890	1417	99	89	310	498
Total	**252**	**252**	**8532**	**8506**	**343**	**343**	**8682**	**8673**	**188**	**188**	**4933**	**4907**

[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.