INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2021
Fecha de Información: 20 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$2169 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.82%[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	395,4	269,0	196,5	312,7	16,5	26,7	56
15-35	765,1	833,3	391,8	334,7	90,5	79,3	351
36-60	16,0	63,8	0,0	4,2	63,8	11,8	0
61-90	13,6	24,7	0,2	10,0	24,5	3,6	0
91-180	108,0	129,6	0,0	7,5	39,6	10,5	90
>180	4,4	44,0	18,3	0,0	24,7	3,4	1
Total	**1302,5**	**1364,3**	**606,7**	**669,2**	**259,6**	**135,3**	**498**

[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	1.76%	1.88%	1.39%	1.61%
15-35	1.89%	1.91%	1.75%	1.85%
36-60	–	2.06%	1.70%	1.99%
61-90	–	1.97%	1.62%	1.93%
91-180	2.04%	2.09%	1.71%	2.01%
>180	2.08%	2.53%	1.99%	2.48%
Total	**1.91%**	**1.97%**	**1.60%**	**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.

[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]	24	58	3175	2759	135	234	4863	6018	93	149	2485	3677
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1707	1511	0	0	3347	1709	0	0	2367	981
Otros[c]	58	24	296	901	234	135	959	1433	149	93	364	533
Total	**82**	**82**	**5178**	**5171**	**369**	**369**	**9169**	**9160**	**242**	**242**	**5216**	**5191**

[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.