

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de junio de 2021
Fecha de Información: 01 de junio 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\$3125 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.11%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	891,2	179,4	71,6	783,9	52,3	51,9	55,5
15-35	756,2	945,4	652,6	520,6	124,4	67,2	168,4
36-60	111,3	94,6	60,0	14,9	32,1	93,9	2,5
61-90	12,0	39,5	0,0	0,0	29,5	2,0	10,0
91-180	23,3	284,8	190,0	0,0	73,9	2,4	20,9
>180	18,0	36,6	10,0	0,0	16,1	7,5	10,5
Total	1812,0	1580,3	984,3	1319,4	328,2	224,9	267,8

^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	2.20%		2.04%	1.82%	1.89%
15-35	2.25%		2.26%	2.21%	2.24%
36-60	2.04%		2.31%	2.11%	2.16%
61-90	2.07%		2.25%	1.39%	2.17%
91-180	1.99%		2.08%	1.91%	2.06%
>180	2.11%		2.49%	2.04%	2.27%
Total	2.21%		2.20%	2.01%	2.11%

^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	31 may. - 04 jun.				07 - 11 jun.				14 - 18 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	181	209	4158	4329	32	110	5171	5786	92	107	5959	6189
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2547	2205	0	0	3302	2250	0	0	2341	1560
Otros ^c	209	181	531	676	110	32	912	918	107	92	2597	3142
Total	390	390	7236	7210	142	142	9385	8954	199	199	10897	10891

^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.