

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de junio de 2021**  
**Fecha de Información: 03 de junio de 2021<sup>1</sup>**

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\$2602 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.22%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	825,8	410,9	172,2	529,8	15,7	73,0	223,0
15-35	566,5	954,1	531,9	271,9	161,2	33,5	261,0
36-60	59,3	34,9	14,5	25,0	20,3	34,3	0,0
61-90	11,2	18,2	2,7	0,0	10,4	6,1	5,1
91-180	24,4	193,1	148,6	0,0	24,5	4,4	20,0
>180	1,2	11,4	0,0	0,0	11,2	0,9	0,3
<b>Total</b>	<b>1488,4</b>	<b>1622,6</b>	<b>869,9</b>	<b>826,8</b>	<b>243,4</b>	<b>152,3</b>	<b>509,4</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	2.23%		2.17%	2.33%	2.27%
15-35	2.21%		2.24%	2.12%	2.20%
36-60	-		2.31%	2.09%	2.15%
61-90	2.10%		2.30%	1.62%	2.09%
91-180	2.04%		2.13%	1.80%	2.09%
>180	1.90%		2.32%	2.87%	2.35%
<b>Total</b>	<b>2.21%</b>		<b>2.22%</b>	<b>2.23%</b>	<b>2.22%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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 <sup>a</sup>	22	164	2880	2949	34	119	6108	6205	93	127	6237	6456
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1725	1553	0	0	3389	2919	0	0	2448	1615
Otros <sup>c</sup>	164	22	254	333	119	34	993	926	127	93	2631	3232
<b>Total</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>4859</b>	<b>4835</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>10490</b>	<b>10050</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>11316</b>	<b>11303</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.