

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de junio de 2021**  
**Fecha de Información: 28 de mayo 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\$2220 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%<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	488,2	309,6	50,1	263,4	75,5	40,8	184,0
15-35	548,0	693,3	303,4	234,0	123,4	47,5	266,5
36-60	37,1	48,5	0,0	13,2	48,5	23,8	0,0
61-90	49,3	32,9	0,6	11,4	32,3	38,0	0,0
91-180	167,6	249,0	52,1	0,0	46,9	17,6	150,0
>180	133,1	158,6	56,8	15,0	6,8	23,1	95,0
<b>Total</b>	<b>1423,4</b>	<b>1491,9</b>	<b>463,0</b>	<b>537,0</b>	<b>333,4</b>	<b>190,8</b>	<b>695,5</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	2.07%		1.31%	1.39%	1.61%
15-35	2.15%		2.10%	2.01%	2.09%
36-60	-		2.00%	1.92%	1.97%
61-90	-		2.02%	1.72%	1.84%
91-180	1.96%		2.09%	1.69%	1.97%
>180	2.19%		2.46%	2.24%	2.25%
<b>Total</b>	<b>2.10%</b>		<b>1.92%</b>	<b>1.73%</b>	<b>1.93%</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	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 <sup>a</sup>	26	133	839	957	172	196	3375	4176	30	105	4929	5469
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	684	613	0	0	2489	1554	0	0	3276	2071
Otros <sup>c</sup>	133	26	223	171	196	172	493	601	105	30	647	882
<b>Total</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>1746</b>	<b>1741</b>	<b>368</b>	<b>368</b>	<b>6357</b>	<b>6331</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>8852</b>	<b>8422</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.