

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de junio de 2021
Fecha de Información: 31 de mayo 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\$841 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.03%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	112,4	284,6	12,0	37,3	261,1	63,6	11,5
15-35	63,5	115,7	72,8	18,5	16,9	19,0	26,0
36-60	4,8	5,6	0,0	0,0	5,6	4,8	0,0
61-90	2,1	6,4	0,0	0,0	6,4	2,1	0,0
91-180	233,2	38,0	0,0	0,0	38,0	233,2	0,0
>180	0,9	11,2	0,0	0,0	11,2	0,9	0,0
Total	416,9	461,4	84,8	55,8	339,1	323,6	37,5

^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	1.99%		2.26%	1.75%	2.12%
15-35	2.05%		2.27%	1.98%	2.15%
36-60	-		2.33%	1.60%	1.99%
61-90	-		1.85%	1.81%	1.84%
91-180	-		1.96%	1.82%	1.84%
>180	-		2.26%	1.83%	2.23%
Total	2.03%		2.23%	1.82%	2.03%

^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	176	202	3468	4225	31	107	4968	5718	92	102	5888	6058
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2501	1613	0	0	3288	2071	0	0	2309	1525
Otros ^c	202	176	527	633	107	31	875	911	102	92	2523	3132
Total	378	378	6496	6471	138	138	9131	8700	194	194	10720	10715

^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.