

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de junio de 2021**  
**Fecha de Información: 04 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\$2470 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.04%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	411,2	605,7	202,3	93,3	249,2	163,8	154,2
15-35	851,3	395,3	53,8	612,8	118,5	15,6	223,0
36-60	14,0	135,2	2,8	0,0	132,4	14,0	0,0
61-90	157,5	73,5	5,2	0,0	63,3	152,5	5,0
91-180	33,3	90,0	0,0	27,0	89,9	6,2	0,1
>180	37,3	78,1	0,0	0,0	48,1	7,3	30,0
<b>Total</b>	<b>1504,6</b>	<b>1377,8</b>	<b>264,1</b>	<b>733,0</b>	<b>701,5</b>	<b>359,4</b>	<b>412,3</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	2.04%		1.92%	1.76%	1.89%
15-35	2.02%		2.37%	2.05%	2.10%
36-60	—		2.33%	1.92%	2.29%
61-90	2.02%		2.27%	1.78%	1.93%
91-180	1.90%		2.33%	1.97%	2.23%
>180	2.62%		2.46%	2.06%	2.48%
<b>Total</b>	<b>2.07%</b>		<b>2.14%</b>	<b>1.93%</b>	<b>2.04%</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>	14	142	480	484	40	128	6337	6637	93	131	6348	6538
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	229	224	0	0	3580	2931	0	0	2449	1697
Otros <sup>c</sup>	142	14	111	102	128	40	1173	1080	131	93	2694	3243
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>820</b>	<b>810</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>11090</b>	<b>10648</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>11491</b>	<b>11478</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.