

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

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

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		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
Total	1504,6	1377,8	264,1	733,0	701,5	359,4	412,3

^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	2.04%	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%
Total	2.07%	2.14%	1.93%	2.04%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	14	142	480	484	40	128	6337	6637	93	131	6348	6538
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	229	224	0	0	3580	2931	0	0	2449	1697
Otros ^c	142	14	111	102	128	40	1173	1080	131	93	2694	3243
Total	156	156	820	810	168	168	11090	10648	224	224	11491	11478

^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.