

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 10 de junio de 2021**  
**Fecha de Información: 08 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\$1767 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>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	514,8	377,7	229,3	321,2	16,4	61,6	132,0
15-35	403,5	403,6	161,0	202,6	97,9	56,2	144,7
36-60	62,5	60,7	0,0	27,3	45,7	20,2	15,0
61-90	4,8	49,7	3,5	0,0	46,3	4,8	0,0
91-180	17,3	110,9	54,0	13,5	56,9	3,8	0,0
>180	0,6	52,4	0,0	0,0	52,1	0,2	0,4
<b>Total</b>	<b>1003,5</b>	<b>1055,1</b>	<b>447,8</b>	<b>564,6</b>	<b>315,3</b>	<b>146,9</b>	<b>292,1</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	1.83%	1.77%	1.63%	1.71%
15-35	1.92%	2.10%	1.75%	1.94%
36-60	2.00%	2.19%	2.00%	2.08%
61-90	—	2.22%	1.92%	2.19%
91-180	—	2.12%	2.00%	2.11%
>180	1.85%	3.08%	2.44%	3.07%
<b>Total</b>	<b>1.88%</b>	<b>2.11%</b>	<b>1.72%</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	07 – 11 jun.				14 - 18 jun.				21 - 25 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	52	133	6742	6972	97	133	6458	6648	45	162	3489	4078
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3781	3167	0	0	2514	1759	0	0	2094	1348
Otros <sup>c</sup>	133	52	1186	1127	133	97	2698	3249	162	45	834	987
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>11709</b>	<b>11266</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>11670</b>	<b>11656</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>6417</b>	<b>6413</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.