

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2021
Fecha de Información: 08 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\$1767 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%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	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
Total	1003,5	1055,1	447,8	564,6	315,3	146,9	292,1

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
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%
Total	1.88%		2.11%	1.72%	1.93%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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 ^a	52	133	6742	6972	97	133	6458	6648	45	162	3489	4078
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3781	3167	0	0	2514	1759	0	0	2094	1348
Otros ^c	133	52	1186	1127	133	97	2698	3249	162	45	834	987
Total	185	185	11709	11266	230	230	11670	11656	207	207	6417	6413

^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.