

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de junio de 2021**  
**Fecha de Información: 22 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\$1919 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.00%<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	283,9	359,7	77,6	162,3	186,1	25,6	96,0
15-35	439,7	618,6	409,3	150,0	41,2	121,6	168,2
36-60	104,6	86,2	0,0	6,1	10,3	22,6	75,8
61-90	192,7	39,2	14,0	6,8	25,2	185,9	0,0
91-180	68,1	36,0	0,0	18,5	6,0	19,6	30,0
>180	29,2	45,7	30,0	10,0	0,7	4,2	15,0
<b>Total</b>	<b>1118,2</b>	<b>1185,4</b>	<b>530,9</b>	<b>353,8</b>	<b>269,5</b>	<b>379,4</b>	<b>385,0</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	2.03%	2.13%	1.64%	1.95%
15-35	2.05%	2.00%	1.98%	2.00%
36-60	2.06%	2.13%	1.86%	2.02%
61-90	—	2.16%	1.93%	1.96%
91-180	2.10%	2.01%	1.97%	2.03%
>180	2.49%	2.73%	2.24%	2.47%
<b>Total</b>	<b>2.07%</b>	<b>2.07%</b>	<b>1.88%</b>	<b>2.00%</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	21 – 25 jun.				28 jun. - 02 jul.				05 - 09 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	61	165	4154	4716	60	202	4258	4974	21	110	2795	2908
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2461	1974	0	0	2384	2039	0	0	1839	1454
Otros <sup>c</sup>	165	61	814	738	202	60	1092	674	110	21	387	638
<b>Total</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>7429</b>	<b>7428</b>	<b>262</b>	<b>262</b>	<b>7734</b>	<b>7687</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>5021</b>	<b>5000</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.