

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de junio de 2021
Fecha de Información: 02 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\$3097 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.60%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	717,3	309,0	90,2	550,3	103,3	51,5	115,5
15-35	672,1	679,4	426,1	490,6	107,7	35,9	145,6
36-60	60,8	153,5	114,6	37,8	38,8	23,1	0,0
61-90	95,6	101,8	0,0	0,0	76,8	70,6	25,0
91-180	74,8	271,7	169,8	35,0	63,4	1,3	38,5
>180	162,1	133,3	110,0	130,0	13,1	21,9	10,2
Total	1782,8	1648,7	910,8	1243,6	403,1	204,3	334,8

^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	2.23%		2.50%	2.11%	2.21%
15-35	2.07%		2.29%	4.55%	3.20%
36-60	-		2.36%	1.99%	2.22%
61-90	2.04%		2.23%	1.94%	2.08%
91-180	2.02%		2.17%	2.00%	2.10%
>180	2.11%		2.16%	2.87%	2.39%
Total	2.12%		2.30%	3.01%	2.60%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	92	178	3847	3669	33	114	5401	5970	92	126	6093	6285
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2210	2243	0	0	3379	2435	0	0	2382	1588
Otros ^c	178	92	403	522	114	33	986	922	126	92	2623	3212
Total	270	270	6460	6434	147	147	9766	9327	218	218	11098	11085

^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.