

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2021
Fecha de Información: 09 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\$2201 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	607,6	381,2	265,0	466,0	18,2	43,7	97,9
15-35	461,0	520,0	329,5	340,6	109,0	38,9	81,5
36-60	15,3	25,0	0,0	0,0	25,0	15,3	0,0
61-90	12,5	40,3	2,0	11,3	38,3	1,2	0,0
91-180	20,7	115,1	63,0	20,5	52,1	0,2	0,0
>180	117,5	160,6	50,0	20,0	14,1	1,0	96,5
Total	1234,6	1242,1	709,5	858,4	256,7	100,4	275,9

^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	1.41%	1.69%	1.88%	1.78%
15-35	1.85%	1.93%	1.86%	1.90%
36-60	—	2.20%	1.82%	2.05%
61-90	—	2.14%	1.96%	2.10%
91-180	—	2.12%	2.02%	2.11%
>180	2.46%	2.34%	2.58%	2.44%
Total	1.91%	1.96%	1.90%	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.

¹ 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.

² 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 ^a	33	119	5836	5838	103	136	6601	6723	45	166	3573	4115
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3315	2947	0	0	2559	1850	0	0	2127	1409
Otros ^c	119	33	932	856	136	103	2701	3274	166	45	839	1010
Total	152	152	10083	9641	239	239	11861	11847	211	211	6539	6534

^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.