

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de junio de 2021
Fecha de Información: 10 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\$3159 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.89%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	428,3	837,2	322,8	346,7	456,9	24,1	57,5
15-35	575,5	466,1	303,5	481,5	117,9	49,3	44,7
36-60	27,6	19,4	0,0	25,0	19,1	2,3	0,3
61-90	1,8	30,3	7,4	1,3	22,9	0,4	0,0
91-180	500,9	277,5	215,0	81,2	47,3	404,5	15,2
>180	36,4	90,4	62,6	18,0	12,8	3,4	15,0
Total	1570,5	1720,9	911,3	953,7	676,8	484,1	132,8

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.88%		1.98%	1.69%	1.89%
15-35	1.77%		1.86%	1.78%	1.81%
36-60	1.86%		2.20%	1.90%	2.02%
61-90	—		2.14%	1.38%	2.13%
91-180	1.99%		2.11%	1.87%	1.93%
>180	2.15%		2.15%	1.87%	2.14%
Total	1.89%		1.98%	1.79%	1.89%

^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	23	86	3486	3841	104	137	6699	7417	85	336	7471	8651
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2709	2356	0	0	2826	1911	0	0	4404	3320
Otros ^c	86	23	479	476	137	104	3104	3287	336	85	1723	1578
Total	109	109	6674	6673	241	241	12629	12615	421	421	13598	13549

^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.