

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2021
Fecha de Información: 15 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\$3329 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.94%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	574,7	839,2	180,0	348,2	486,7	54,0	172,5
15-35	640,8	874,7	599,4	321,9	40,8	84,5	234,5
36-60	45,5	19,9	11,3	0,0	8,6	45,5	0,0
61-90	11,4	15,3	0,0	1,8	15,3	9,5	0,0
91-180	460,2	168,5	143,8	0,0	14,7	450,2	10,0
>180	52,1	68,7	32,1	0,0	11,7	27,1	25,0
Total	1784,7	1986,3	966,6	671,8	577,6	670,8	442,0

^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	1.88%	2.00%	1.88%	1.95%
15-35	1.93%	1.98%	1.85%	1.93%
36-60	—	2.20%	1.72%	1.80%
61-90	—	1.38%	1.73%	1.53%
91-180	2.02%	2.15%	1.88%	1.89%
>180	2.52%	2.27%	2.31%	2.38%
Total	1.94%	1.99%	1.88%	1.94%

^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	14 – 18 jun.				21 - 25 jun.				28 jun. - 02 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	120	146	7474	8256	54	174	3953	4631	43	197	3792	4421
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2972	2440	0	0	2334	1594	0	0	2228	1812
Otros ^c	146	120	3579	3316	174	54	1009	1066	197	43	857	601
Total	266	266	14025	14012	228	228	7296	7291	240	240	6877	6834

^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.