

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2021
Fecha de Información: 17 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\$2686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.85%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	435,8	602,7	108,5	220,8	316,2	37,1	177,9
15-35	331,6	787,0	627,5	232,2	113,6	53,5	45,9
36-60	18,3	4,3	3,1	0,0	1,2	18,3	0,0
61-90	327,1	52,3	0,0	1,7	52,3	325,4	0,0
91-180	71,8	39,7	31,1	50,0	7,3	20,6	1,3
>180	67,2	224,8	154,0	10,0	19,3	5,8	51,5
Total	1251,9	1710,8	924,3	514,7	509,9	460,7	276,5

^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	1.95%	1.26%	1.45%	1.47%
15-35	2.00%	2.00%	1.93%	1.98%
36-60	—	2.32%	1.71%	1.78%
61-90	—	2.30%	1.85%	1.91%
91-180	1.70%	2.19%	1.98%	1.99%
>180	2.58%	2.62%	2.03%	2.60%
Total	2.07%	1.84%	1.79%	1.85%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	89	83	3019	3160	60	180	4225	5206	47	201	3985	4526
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1839	1416	0	0	2431	1675	0	0	2258	1920
Otros ^c	83	89	639	921	180	60	1317	1086	201	47	897	650
Total	172	172	5497	5497	240	240	7973	7967	248	248	7140	7096

^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.