

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2021
Fecha de Información: 18 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\$2576 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.99%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	529,3	498,7	180,9	332,8	159,6	38,4	158,2
15-35	268,5	898,3	766,2	171,6	62,0	26,9	70,0
36-60	38,5	4,9	2,1	1,3	1,9	36,3	0,9
61-90	323,3	51,7	20,0	100,2	1,7	193,1	30,0
91-180	95,2	16,4	0,0	50,0	6,4	35,2	10,0
>180	56,7	79,0	63,0	30,0	1,0	11,7	15,0
Total	1311,5	1548,9	1032,2	685,9	232,6	341,5	284,1

^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	1.97%	1.98%	1.87%	1.93%
15-35	1.96%	2.02%	1.95%	2.01%
36-60	1.98%	2.41%	1.89%	1.92%
61-90	1.99%	2.02%	1.94%	1.95%
91-180	2.06%	2.29%	2.03%	2.05%
>180	2.65%	2.68%	2.31%	2.61%
Total	2.01%	2.04%	1.93%	1.99%

^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	13	61	479	535	61	189	4705	5586	48	201	4090	4660
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	332	324	0	0	2532	1992	0	0	2329	1973
Otros ^c	61	13	114	67	189	61	1465	1118	201	48	917	656
Total	74	74	925	926	250	250	8702	8696	249	249	7336	7289

^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.