

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2021
Fecha de Información: 21 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\$1464 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.97%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	361,9	259,6	206,5	297,9	4,1	15,0	49
15-35	236,3	541,8	462,9	138,6	7,8	26,7	71
36-60	45,7	44,7	25,0	0,0	14,7	40,7	5
61-90	9,3	1,3	0,0	1,5	1,3	7,8	0
91-180	7,2	41,9	0,9	0,0	41,0	7,2	0
>180	33,4	36,0	1,0	0,0	5,0	3,4	30
Total	693,8	925,2	696,4	438,0	73,9	100,8	155

^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	2.07%		1.54%	1.90%	1.83%
15-35	2.02%		2.04%	2.20%	2.01%
36-60	2.03%		2.06%	1.81%	1.94%
61-90	—		2.27%	1.88%	1.93%
91-180	—		2.24%	1.85%	2.18%
>180	2.79%		2.71%	2.08%	2.72%
Total	2.19%		1.95%	1.91%	1.97%

^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	21 – 25 jun.				28 jun. - 02 jul.				05 - 09 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	66	197	5098	5790	52	201	4181	4699	20	106	2725	2806
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2731	2199	0	0	2337	2028	0	0	1789	1430
Otros ^c	197	66	1469	1304	201	52	919	664	106	20	373	629
Total	263	263	9298	9293	253	253	7437	7391	126	126	4887	4865

^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.