

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2021
Fecha de Información: 23 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\$2156 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.06%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	623,1	529,2	273,2	337,1	42,3	72,3	213,7
15-35	556,2	750,7	357,9	186,4	58,6	35,6	334,2
36-60	12,1	9,3	1,6	0,0	7,7	12,1	0,0
61-90	61,4	49,5	0,0	20,0	39,5	31,4	10,0
91-180	54,5	9,3	0,0	0,5	9,3	54,0	0,0
>180	17,6	51,6	40,0	5,0	1,6	2,6	10,0
Total	1324,8	1399,6	672,7	549,0	158,9	207,9	567,9

^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	2.00%	2.16%	1.98%	2.04%
15-35	2.04%	2.08%	1.98%	2.04%
36-60	—	2.33%	1.84%	2.03%
61-90	2.10%	2.21%	1.99%	2.09%
91-180	—	2.27%	2.05%	2.08%
>180	2.75%	2.74%	2.50%	2.71%
Total	2.04%	2.17%	1.99%	2.06%

^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	57	156	3114	3436	61	202	4527	5164	22	111	2911	3123
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1820	1476	0	0	2499	2229	0	0	1958	1484
Otros ^c	156	57	649	671	202	61	1106	692	111	22	416	655
Total	213	213	5583	5583	263	263	8132	8085	133	133	5285	5262

^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.