

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de julio de 2021
Fecha de Información: 29 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\$2415 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.01%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	251,2	376,1	145,8	180,6	188,8	29,2	41,4
15-35	618,1	663,4	450,7	318,2	62,0	149,2	150,7
36-60	10,4	30,9	16,9	0,0	13,9	10,4	0,0
61-90	27,3	106,3	70,2	1,5	26,1	15,8	10,0
91-180	211,2	211,8	160,0	80,0	41,8	121,2	10,0
>180	79,8	100,9	15,0	15,0	25,9	4,8	60,0
Total	1198,1	1489,3	858,6	595,3	358,5	330,7	272,1

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.89%		1.92%	1.85%	1.90%
15-35	1.92%		1.96%	1.93%	1.94%
36-60	—		2.06%	1.85%	2.01%
61-90	2.00%		2.09%	1.99%	2.07%
91-180	2.08%		2.15%	1.99%	2.08%
>180	3.00%		2.73%	2.53%	2.85%
Total	2.16%		2.02%	1.94%	2.01%

^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	28 jun. - 02 jul.				05 - 09 jul.				12 - 16 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	62	196	3814	4082	34	115	3369	3577	51	131	4773	5475
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2226	2100	0	0	2233	1749	0	2	2809	1619
Otros ^c	196	62	777	588	115	34	480	719	131	49	1455	1926
Total	258	258	6817	6770	149	149	6082	6045	182	182	9037	9020

^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.