INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de junio de 2021
Fecha de Información: 11 de junio de 2021[1]

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$2117 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.82%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	454,0	370,5	163,8	288,0	78,6	37,9	128,1
15-35	553,0	854,3	521,4	205,3	114,8	129,6	218,1
36-60	1,6	34,9	0,0	0,0	34,9	1,6	0,0
61-90	12,4	23,6	4,7	0,0	19,0	12,4	0,0
91-180	59,8	32,5	6,6	20,0	10,5	24,3	15,5
>180	26,1	66,5	52,0	0,0	4,5	16,1	10,0
Total	**1106,8**	**1382,3**	**748,4**	**513,3**	**262,2**	**221,8**	**371,7**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	1.81%	1.91%	1.56%	1.73%
15-35	1.81%	1.85%	1.79%	1.83%
36-60	–	1.89%	1.79%	1.89%
61-90	–	2.17%	1.84%	2.06%
91-180	1.97%	2.04%	1.88%	1.94%
>180	2.14%	2.20%	2.42%	2.26%
Total	**1.82%**	**1.89%**	**1.70%**	**1.82%**

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	07 – 11 jun.				14 - 18 jun.				21 - 25 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	19	39	1558	1774	106	142	7092	7670	86	368	7623	8839
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1151	1174	0	0	2846	2121	0	0	4517	3387
Otros[c]	39	19	359	121	142	106	3169	3303	368	86	1746	1610
Total	**58**	**58**	**3068**	**3069**	**248**	**248**	**13107**	**13094**	**454**	**454**	**13886**	**13836**

[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.