INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2021
Fecha de Información: 16 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$1785 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.03%[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	361,2	287,5	185,8	228,4	9,2	40,3	92,5
15-35	436,5	614,6	376,9	241,5	88,3	45,6	149,4
36-60	7,1	71,5	57,6	0,0	13,9	7,1	0,0
61-90	25,0	3,3	0,0	0,6	3,3	24,5	0,0
91-180	2,4	4,4	0,0	1,2	4,4	1,2	0,0
>180	90,2	133,6	111,7	59,8	12,0	20,4	10,0
Total	**922,5**	**1114,9**	**732,0**	**531,6**	**131,0**	**139,0**	**251,9**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	2.10%	1.91%	1.92%	1.95%
15-35	1.97%	2.02%	1.96%	1.99%
36-60	–	2.08%	1.87%	2.05%
61-90	–	2.25%	1.92%	1.95%
91-180	–	2.50%	1.86%	2.27%
>180	2.15%	2.52%	2.41%	2.46%
Total	**2.02%**	**2.07%**	**1.98%**	**2.03%**

[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

	14 – 18 jun.				21 - 25 jun.				28 jun. - 02 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	107	104	4252	4768	59	177	4052	4654	45	200	3894	4483
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2741	1792	0	0	2341	1665	0	0	2244	1880
Otros[c]	104	107	928	1362	177	59	1014	1081	200	45	890	621
Total	**211**	**211**	**7921**	**7922**	**236**	**236**	**7407**	**7400**	**245**	**245**	**7028**	**6984**

[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.