

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2021
Fecha de Información: 24 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\$2388 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.09%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	288,3	365,1	164,1	111,1	38,6	14,9	162,4
15-35	846,6	618,7	308,0	484,7	22,2	73,4	288,5
36-60	13,5	8,0	0,0	0,0	8,0	13,5	0,0
61-90	123,5	243,2	147,0	16,1	13,2	24,4	83,0
91-180	195,3	203,7	140,0	114,0	3,7	21,3	60,0
>180	29,0	72,1	45,0	0,0	2,1	4,0	25,0
Total	1496,1	1510,9	804,1	725,9	87,9	151,4	618,9

^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	2.06%		2.03%	1.91%	2.00%
15-35	2.08%		2.08%	2.09%	2.09%
36-60	-		2.24%	3.40%	2.97%
61-90	2.08%		2.13%	1.96%	2.09%
91-180	2.13%		2.13%	1.98%	2.11%
>180	2.22%		2.30%	1.89%	2.24%
Total	2.09%		2.11%	2.07%	2.09%

^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.

¹A 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.

²El 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	19	116	2176	2409	62	205	4651	5271	22	111	3044	3352
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1232	968	0	0	2537	2287	0	0	2067	1519
Otros ^c	116	19	377	408	205	62	1118	702	111	22	441	658
Total	135	135	3785	3785	267	267	8306	8260	133	133	5552	5529

^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.