

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de junio de 2021
Fecha de Información: 25 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\$1950 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.10%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	488,7	271,0	226,9	455,2	34,0	23,5	10
15-35	440,4	331,4	293,4	362,5	17,0	56,9	21
36-60	5,2	31,1	22,0	0,0	9,1	5,2	0
61-90	51,4	62,6	35,0	7,9	7,6	23,5	20
91-180	26,7	181,0	155,0	0,5	16,0	16,2	10
>180	66,6	84,6	50,0	0,0	4,6	36,6	30
Total	1079,0	961,8	782,4	826,1	88,4	161,9	91

^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	1.97%		2.01%	1.98%	1.99%
15-35	2.13%		2.06%	2.01%	2.04%
36-60	-		2.27%	1.82%	2.20%
61-90	2.15%		2.23%	2.00%	2.15%
91-180	2.16%		2.16%	2.05%	2.15%
>180	2.68%		2.91%	2.73%	2.79%
Total	2.30%		2.15%	2.03%	2.10%

^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	11	76	363	602	65	211	4996	5511	23	113	3196	3399
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	211	53	0	0	2753	2611	0	0	2090	1658
Otros ^c	76	11	184	103	211	65	1131	712	113	23	464	672
Total	87	87	758	758	276	276	8880	8834	136	136	5750	5729

^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.