

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de junio de 2021
Fecha de Información: 28 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\$1743 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.99%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	440,9	186,0	77,5	281,6	11,0	61,8	97,5
15-35	444,7	580,8	410,0	231,3	25,8	68,3	145,0
36-60	7,1	99,5	10,0	0,0	89,5	7,1	0,0
61-90	8,8	27,5	0,7	0,0	26,8	8,8	0,0
91-180	101,4	33,6	0,0	0,0	23,6	91,4	10,0
>180	53,2	33,6	10,0	25,0	1,6	6,2	22,0
Total	1056,0	961,0	508,2	537,9	178,3	243,6	274,5

^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	1.91%		1.81%	1.87%	1.87%
15-35	1.96%		2.03%	1.96%	1.99%
36-60	-		2.17%	1.72%	2.14%
61-90	-		2.25%	1.73%	2.12%
91-180	2.20%		2.40%	2.01%	2.10%
>180	2.55%		2.71%	2.61%	2.58%
Total	2.00%		2.05%	1.93%	1.99%

^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	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	77	221	5253	5689	31	114	3322	3463	49	125	4557	5269
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2793	2792	0	0	2134	1715	0	0	2784	1605
Otros ^c	221	77	1202	719	114	31	469	710	125	49	1448	1898
Total	298	298	9248	9200	145	145	5925	5888	174	174	8789	8772

^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.