

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de julio de 2021
Fecha de Información: 01 de julio 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\$2010 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.95%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	339,5	404,0	181,1	144,0	91,2	63,8	131,7
15-35	420,6	840,3	602,1	185,4	40,7	37,7	197,5
36-60	33,3	10,9	0,0	7,5	10,9	25,8	0,0
61-90	72,1	82,4	46,3	0,6	36,1	71,5	0,0
91-180	52,3	7,0	0,0	20,0	7,0	32,3	0,0
>180	54,0	22,2	20,0	46,3	2,2	7,7	0,0
Total	971,8	1366,9	849,5	403,9	188,2	238,7	329,1

^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	2.02%		1.91%	1.67%	1.86%
15-35	1.97%		2.00%	1.87%	1.96%
36-60	-		2.26%	1.89%	1.98%
61-90	-		2.20%	1.91%	2.01%
91-180	-		2.23%	2.05%	2.07%
>180	-		3.00%	2.39%	2.84%
Total	1.99%		2.02%	1.83%	1.95%

^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	32	55	2305	2202	37	118	3699	3952	97	255	7735	8620
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1228	1472	0	0	2461	1980	0	4	4655	2745
Otros ^c	55	32	427	262	118	37	556	745	255	93	2011	3002
Total	87	87	3960	3936	155	155	6716	6677	352	352	14401	14367

^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.