

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de julio de 2021
Fecha de Información: 02 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\$1501 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.02%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	194,3	194,0	135,0	146,2	18,0	7,2	41
15-35	359,7	365,8	282,8	277,8	39,9	38,9	43
36-60	9,4	22,6	0,0	0,0	22,6	9,4	0
61-90	72,9	125,8	89,8	18,4	26,0	44,5	10
91-180	32,4	9,9	0,0	30,0	9,9	2,4	0
>180	124,3	93,8	46,0	110,0	37,8	4,3	10
Total	793,0	811,9	553,6	582,4	154,3	106,6	104

^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	2.01%		1.68%	1.19%	1.51%
15-35	1.98%		1.96%	1.93%	1.95%
36-60	-		2.13%	1.77%	2.03%
61-90	2.05%		2.10%	1.89%	2.00%
91-180	-		2.22%	1.98%	2.08%
>180	3.09%		3.53%	4.02%	3.62%
Total	2.10%		2.16%	1.85%	2.02%

^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	11	34	608	525	39	123	3918	4137	52	133	4939	5752
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	208	296	0	0	2592	2153	0	2	2908	1641
Otros ^c	34	11	196	191	123	39	568	750	133	50	1532	1965
Total	45	45	1012	1012	162	162	7078	7040	185	185	9379	9358

^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.