

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2021
Fecha de Información: 12 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\$2643 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	742,5	287,1	128,8	209,6	83,3	457,9	75
15-35	424,9	651,6	469,6	222,2	13,0	33,7	169
36-60	97,8	504,4	50,0	0,0	454,4	97,8	0
61-90	21,2	27,4	1,8	0,0	25,6	21,2	0
91-180	31,4	12,1	0,0	10,0	12,1	21,4	0
>180	55,0	61,6	30,0	0,4	1,6	24,6	30
Total	1372,8	1544,3	680,2	442,2	590,1	656,6	274

^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	1.93%		1.78%	1.87%	1.86%
15-35	2.06%		2.06%	2.03%	2.05%
36-60	-		1.78%	2.05%	1.82%
61-90	-		2.10%	1.89%	2.00%
91-180	-		2.29%	1.98%	2.09%
>180	2.65%		3.28%	3.06%	3.00%
Total	2.09%		1.92%	1.95%	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	12 – 16 jul.				19 - 23 jul.				26 - 30 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	68	160	6534	6933	52	127	3311	3220	42	251	6521	7594
Intragrupo y off-shore ^b	0	2	3255	2225	0	2	1982	1505	7	2	4538	2669
Otros ^c	160	66	2064	2670	127	50	519	1074	244	40	1118	1858
Total	228	228	11853	11828	179	179	5812	5799	293	293	12177	12121

^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.