

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2021
Fecha de Información: 22 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\$1534 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.85%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	345,8	268,1	111,4	96,8	36,8	129,1	119,9
15-35	403,3	591,6	336,8	145,7	87,8	90,5	167,0
36-60	35,6	54,2	27,0	0,0	2,2	10,6	25,0
61-90	2,3	21,9	0,0	0,0	21,9	2,3	0,0
91-180	36,3	45,0	1,0	0,0	21,0	13,3	23,0
>180	62,7	37,5	0,0	20,0	2,0	7,2	35,5
Total	886,0	1018,2	476,2	262,6	171,6	253,0	370,4

^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	1.90%		1.83%	1.50%	1.69%
15-35	1.91%		1.92%	1.67%	1.85%
36-60	2.00%		2.02%	1.65%	1.95%
61-90	-		2.15%	1.63%	2.10%
91-180	1.97%		2.07%	1.83%	1.98%
>180	2.81%		2.69%	2.36%	2.62%
Total	2.00%		1.93%	1.64%	1.85%

^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	19 – 23 jul.				26 - 30 jul.				02 - 06 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	18	85	2487	2327	46	164	4521	5619	19	94	3791	4127
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1246	1253	4	2	3336	1950	3	0	2252	1411
Otros ^c	85	18	403	544	160	44	1087	1338	91	19	361	838
Total	103	103	4136	4124	210	210	8944	8907	113	113	6404	6376

^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.