

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2021
Fecha de Información: 27 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\$2087 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.97%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	395,3	286,1	112,2	221,4	56,9	56,9	117,0
15-35	554,7	661,7	342,3	255,6	53,6	33,4	265,7
36-60	34,8	39,9	1,1	15,1	38,8	19,7	0,0
61-90	69,2	82,0	0,0	0,0	32,0	19,2	50,0
91-180	61,6	187,6	150,0	0,0	12,4	36,4	25,2
>180	168,7	119,9	0,0	40,0	2,9	11,7	117,0
Total	1284,3	1377,3	605,6	532,1	196,7	177,2	574,9

^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	2.73%		1.91%	1.62%	1.99%
15-35	1.96%		1.95%	1.84%	1.92%
36-60	-		2.03%	1.91%	1.99%
61-90	1.88%		2.04%	1.75%	1.90%
91-180	1.99%		1.91%	1.81%	1.90%
>180	2.21%		2.92%	2.19%	2.22%
Total	2.16%		1.95%	1.79%	1.97%

^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	26 – 30 jul.				02 - 06 ago.				09 - 13 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	45	176	4192	4925	21	99	4169	4651	52	122	3499	4027
Intragrupo y off-shore ^b	4	2	2641	1831	3	0	2392	1570	0	0	2287	1336
Otros ^c	172	43	1311	1367	96	21	541	848	122	52	484	844
Total	221	221	8144	8123	120	120	7102	7069	174	174	6270	6207

^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.