

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2021
Fecha de Información: 28 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\$2174 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.84%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	679,5	380,8	201,3	480,9	15,4	34,5	164,0
15-35	433,7	721,8	532,2	216,7	23,4	50,9	166,2
36-60	91,3	12,2	0,3	40,7	12,0	50,6	0,0
61-90	26,1	33,7	0,0	0,1	33,7	26,0	0,0
91-180	23,3	52,2	25,9	0,0	13,8	10,8	12,5
>180	29,0	38,4	30,0	10,0	2,9	13,5	5,5
Total	1282,9	1239,2	789,7	748,4	101,3	186,3	348,2

^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	1.75%		1.87%	1.80%	1.80%
15-35	1.77%		1.93%	1.72%	1.84%
36-60	-		2.20%	1.79%	1.85%
61-90	-		2.10%	1.76%	1.95%
91-180	2.06%		2.30%	1.88%	2.10%
>180	2.24%		2.86%	2.25%	2.30%
Total	1.77%		1.95%	1.80%	1.84%

^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	156	3691	3968	21	101	4335	4748	58	126	3549	4082
Intragruppo y off-shore ^b	4	2	2260	1708	3	0	2469	1725	0	0	2325	1336
Otros ^c	152	43	909	1163	98	21	553	851	126	58	489	881
Total	201	201	6860	6839	122	122	7357	7324	184	184	6363	6299

^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.