

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de agosto de 2021
Fecha de Información: 29 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\$2367 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.71%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	416,9	253,9	145,6	352,0	93,4	49,9	14,9
15-35	650,2	647,3	476,2	504,3	51,4	26,2	119,8
36-60	27,9	97,5	32,4	0,0	65,1	27,9	0,0
61-90	43,0	30,2	0,0	0,0	25,2	38,0	5,0
91-180	33,9	323,1	275,9	0,0	18,3	4,9	29,0
>180	2,2	9,3	0,0	0,0	9,3	2,2	0,0
Total	1174,1	1361,3	930,0	856,3	262,6	149,1	168,7

^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	1.79%		1.62%	1.61%	1.62%
15-35	1.84%		1.85%	1.47%	1.69%
36-60	-		1.96%	1.80%	1.93%
61-90	1.82%		2.14%	1.59%	1.81%
91-180	1.96%		1.79%	1.46%	1.80%
>180	-		2.61%	2.26%	2.54%
Total	1.85%		1.83%	1.56%	1.71%

^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	32	101	2477	2463	30	102	4621	4904	58	129	3619	4175
Intragrupo y off-shore ^b	2	2	1356	1247	3	0	2557	1989	0	0	2408	1368
Otros ^c	99	30	596	698	99	30	605	858	129	58	470	890
Total	133	133	4429	4408	132	132	7783	7751	187	187	6497	6433

^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.