

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de agosto de 2021
Fecha de Información: 30 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\$2307 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.54%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	386,8	625,9	292,4	261,5	259,2	51,0	74,3
15-35	249,4	531,4	391,0	96,8	52,4	64,7	88,0
36-60	17,8	25,0	10,6	0,1	14,4	17,7	0,0
61-90	328,6	32,5	10,0	70,0	12,5	248,6	10,0
91-180	41,4	128,7	102,9	0,0	5,8	21,4	20,0
>180	125,7	21,1	0,0	80,0	6,1	30,7	15,0
Total	1149,8	1364,6	806,9	508,4	350,4	434,1	207,3

^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	1.85%		0.69%	1.43%	1.11%
15-35	1.83%		1.87%	1.72%	1.84%
36-60	-		2.08%	1.72%	1.88%
61-90	1.87%		2.14%	1.74%	1.76%
91-180	2.00%		2.09%	1.89%	2.01%
>180	2.41%		2.81%	2.23%	2.33%
Total	1.90%		1.37%	1.64%	1.54%

^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	16	61	551	588	33	105	4869	5349	59	130	3703	4350
Intragrupo y off-shore ^b	2	0	326	266	3	0	2680	2106	0	0	2548	1440
Otros ^c	59	16	172	195	102	33	834	895	130	59	504	903
Total	77	77	1049	1049	138	138	8383	8350	189	189	6755	6693

^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.