

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2021
Fecha de Información: 08 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\$2448 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.99%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	290,9	239,3	168,1	220,6	16,3	15,4	54,9
15-35	669,3	690,0	551,2	512,2	8,8	27,1	130,0
36-60	7,0	25,5	0,0	1,1	25,5	5,9	0,0
61-90	68,8	396,8	330,0	2,1	31,8	31,8	35,0
91-180	98,4	103,1	90,0	0,3	3,1	88,1	10,0
>180	72,8	20,7	10,0	10,0	5,7	57,8	5,0
Total	1207,3	1475,4	1149,3	746,3	91,2	226,1	234,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.96%		2.06%	1.60%	1.81%
15-35	2.03%		1.99%	1.97%	1.99%
36-60	—		2.04%	1.57%	1.94%
61-90	2.02%		2.07%	1.89%	2.01%
91-180	2.22%		2.04%	2.01%	2.03%
>180	3.28%		2.98%	2.58%	2.70%
Total	2.05%		2.04%	1.91%	1.99%

^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.

¹ A 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.

² El 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	05 – 09 jul.				12 - 16 jul.				19 - 23 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	84	2077	2168	57	137	5273	6050	47	126	3206	3178
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1372	1043	0	2	3023	1845	0	2	1967	1420
Otros ^c	84	22	295	498	137	55	1619	1997	126	45	510	1071
Total	106	106	3744	3709	194	194	9915	9892	173	173	5683	5669

^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.