

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2021
Fecha de Información: 13 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\$2378 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.96%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	620,8	652,1	239,5	317,4	180,6	71,4	232,0
15-35	526,3	627,7	329,8	193,7	11,5	46,1	286,5
36-60	62,4	34,2	0,0	0,0	9,2	37,4	25,0
61-90	209,4	58,2	0,0	50,0	34,2	135,4	24,0
91-180	40,8	77,4	20,0	0,0	17,4	0,8	40,0
>180	17,5	69,9	55,0	0,3	3,9	6,3	11,0
Total	1477,2	1519,6	644,3	561,3	256,8	297,4	618,5

^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	1.97%		1.98%	1.74%	1.88%
15-35	2.03%		2.03%	1.95%	2.01%
36-60	1.94%		2.24%	1.87%	1.94%
61-90	2.03%		2.17%	2.00%	2.03%
91-180	1.99%		2.33%	1.60%	2.15%
>180	2.62%		2.39%	2.16%	2.42%
Total	2.01%		2.04%	1.84%	1.96%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	12 - 16 jul.				19 - 23 jul.				26 - 30 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	55	162	6430	6729	53	129	3436	3465	31	158	3876	4505
Intragrupo y off-shore ^b	0	2	3132	2230	0	2	2095	1562	4	2	2692	1640
Otros ^c	162	53	1931	2509	129	51	587	1077	154	29	822	1208
Total	217	217	11493	11468	182	182	6118	6104	189	189	7390	7353

^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.