

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2021
Fecha de Información: 14 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\$2037 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	599,6	414,1	162,9	338,8	112,4	122,1	138,8
15-35	481,4	746,4	375,7	99,9	23,3	34,0	347,5
36-60	31,4	16,0	2,5	0,0	8,5	26,4	5,0
61-90	77,6	83,3	0,8	4,0	51,6	42,7	30,9
91-180	33,5	48,2	0,0	0,0	28,2	13,5	20,0
>180	34,2	39,6	12,6	0,0	1,0	8,2	26,0
Total	1257,7	1347,7	554,5	442,6	225,0	246,9	568,2

^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	1.94%	2.04%	1.76%	1.87%
15-35	1.97%	1.98%	1.89%	1.97%
36-60	1.89%	2.23%	1.91%	1.98%
61-90	1.95%	2.15%	1.92%	2.02%
91-180	1.93%	2.21%	1.86%	2.05%
>180	2.77%	3.35%	2.35%	2.85%
Total	2.00%	2.06%	1.81%	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.

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	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	52	134	5403	5428	54	130	3474	3690	42	252	7056	8099
Intragruppo y off-shore ^b	0	2	2377	1808	0	2	2180	1563	7	2	4773	2824
Otros ^c	134	50	1715	2234	130	52	692	1079	245	40	1143	1995
Total	186	186	9495	9470	184	184	6346	6332	294	294	12972	12918

^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.