

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2310 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.84%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	464,5	239,5	175,8	387,6	10,1	23,3	53,5
15-35	596,4	583,5	440,2	412,6	20,7	61,2	122,6
36-60	27,6	28,7	4,6	0,0	24,1	27,6	0,0
61-90	95,0	170,7	129,1	48,7	21,6	26,3	20,0
91-180	79,7	90,0	80,0	50,0	10,0	29,7	0,0
>180	33,2	122,4	96,3	0,0	0,6	7,7	25,5
Total	1296,3	1234,8	926,0	898,9	87,2	175,8	221,6

^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	1.77%	1.35%	1.84%	1.70%
15-35	1.94%	1.87%	1.90%	1.89%
36-60	—	2.02%	1.84%	1.92%
61-90	1.88%	1.95%	1.77%	1.89%
91-180	—	2.31%	1.89%	1.99%
>180	2.36%	2.58%	2.50%	2.46%
Total	1.94%	1.77%	1.87%	1.84%

^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	21	100	4182	4246	57	133	3722	3743	32	160	4045	4738
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1863	1483	0	2	2220	1804	4	2	2814	1672
Otros ^c	100	21	1499	1805	133	55	701	1083	156	30	832	1243
Total	121	121	7544	7534	190	190	6643	6630	192	192	7691	7653

^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.