

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2021
Fecha de Información: 16 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\$2432 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.81%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	341,2	727,4	602,0	278,1	90,9	28,5	34,6
15-35	605,4	512,9	311,0	422,5	30,9	11,9	171,0
36-60	53,8	28,5	1,2	0,0	27,3	53,8	0,0
61-90	45,7	50,9	20,0	0,0	10,9	25,7	20,0
91-180	111,2	102,9	30,0	87,0	62,9	14,2	10,0
>180	47,2	57,1	35,7	25,0	5,1	5,9	16,3
Total	1204,6	1479,7	999,8	812,6	227,9	140,1	251,9

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.84%	1.48%	1.38%	1.46%
15-35	2.19%	1.89%	1.79%	1.91%
36-60	—	1.93%	1.75%	1.81%
61-90	1.84%	2.04%	1.68%	1.80%
91-180	1.83%	4.47%	1.84%	3.92%
>180	2.21%	2.61%	2.66%	2.38%
Total	2.10%	1.88%	1.62%	1.81%

^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	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	8	47	970	1137	58	135	4076	3996	33	161	4092	5270
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	819	574	0	2	2411	2109	4	2	3261	1695
Otros ^c	47	8	104	177	135	56	738	1105	157	31	895	1248
Total	55	55	1893	1888	193	193	7225	7210	194	194	8248	8213

^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.