

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2021
Fecha de Información: 19 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\$1598 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.77%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	485,7	357,8	121,4	234,4	106,8	121,7	129,6
15-35	319,9	485,9	325,6	129,8	12,3	42,1	148,0
36-60	65,2	10,3	1,1	0,0	8,1	64,1	1,1
61-90	37,0	31,6	0,0	0,0	31,6	37,0	0,0
91-180	20,8	36,7	0,0	0,0	26,7	10,8	10,0
>180	30,0	16,2	0,0	0,0	6,2	20,0	10,0
Total	958,6	938,4	448,1	364,2	191,6	295,6	298,7

^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	1.74%	1.83%	Inf%	1.59%
15-35	1.86%	1.91%	1.78%	1.87%
36-60	1.83%	2.21%	1.80%	1.85%
61-90	—	2.06%	1.72%	1.88%
91-180	1.84%	2.13%	1.73%	1.98%
>180	2.84%	2.79%	2.29%	2.53%
Total	1.84%	1.92%	1.57%	1.77%

^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	19 – 23 jul.				26 - 30 jul.				02 - 06 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	66	142	4367	4064	43	162	4165	5463	12	94	3390	3729
Intragrupo y off-shore ^b	0	2	2426	2253	4	2	3325	1735	3	0	2135	1328
Otros ^c	142	64	747	1209	158	41	1001	1255	91	12	330	781
Total	208	208	7540	7526	205	205	8491	8453	106	106	5855	5838

^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.