

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2021
Fecha de Información: 21 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\$2369 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.90%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	490,4	246,5	45,7	285,5	103,1	107,2	97,7
15-35	720,8	861,9	490,5	252,8	25,6	122,2	345,8
36-60	80,8	29,5	10,0	0,0	19,5	80,8	0,0
61-90	27,9	48,7	10,0	10,0	38,7	17,9	0,0
91-180	34,3	144,2	123,0	0,0	21,2	34,3	0,0
>180	107,0	85,7	9,0	10,0	11,7	32,0	65,0
Total	1461,2	1416,5	688,2	558,3	219,8	394,3	508,6

^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	1.73%	1.87%	1.56%	1.70%
15-35	1.95%	1.98%	1.84%	1.93%
36-60	—	1.97%	1.82%	1.86%
61-90	—	1.96%	1.54%	1.85%
91-180	—	2.03%	1.88%	1.96%
>180	2.19%	3.03%	2.36%	2.38%
Total	1.94%	1.99%	1.77%	1.90%

^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	60	122	3763	3352	45	162	4329	5571	17	94	3566	3893
Intragrupo y off-shore ^b	0	2	1833	1728	4	2	3327	1866	3	0	2183	1364
Otros ^c	122	58	696	1199	158	43	1077	1259	91	17	331	806
Total	182	182	6292	6279	207	207	8733	8696	111	111	6080	6063

^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.