

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2021
Fecha de Información: 23 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\$1594 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.70%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	621,6	530,8	175,4	262,0	81,4	85,6	274
15-35	268,2	286,8	204,2	154,4	19,6	50,9	63
36-60	6,2	6,5	3,2	0,0	3,2	6,2	0
61-90	27,2	60,8	23,6	0,0	37,2	27,2	0
91-180	50,5	30,1	0,2	0,4	14,9	35,0	15
>180	32,6	28,9	20,0	20,2	4,9	8,4	4
Total	1006,3	943,9	426,6	437,0	161,2	213,3	356

^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	1.88%	1.74%	1.09%	1.54%
15-35	1.90%	1.90%	1.78%	1.85%
36-60	—	1.98%	1.65%	1.77%
61-90	—	2.08%	1.82%	1.97%
91-180	1.95%	2.07%	1.87%	1.93%
>180	2.73%	2.69%	2.41%	2.56%
Total	1.90%	1.88%	1.41%	1.70%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	11	52	693	618	59	169	4814	5741	19	94	3987	4420
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	286	367	4	2	3363	2079	3	0	2368	1497
Otros ^c	52	11	156	149	165	57	1100	1419	91	19	436	841
Total	63	63	1135	1134	228	228	9277	9239	113	113	6791	6758

^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.