

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de julio de 2021
Fecha de Información: 07 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\$2147 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.95%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	430,3	352,8	169,8	190,3	70,0	127,0	113,0
15-35	570,4	724,0	484,7	354,6	78,2	54,6	161,1
36-60	12,7	25,7	1,4	0,0	24,3	12,7	0,0
61-90	31,3	20,0	0,8	0,1	19,2	31,2	0,0
91-180	48,6	176,2	135,0	0,1	1,2	8,5	40,0
>180	18,9	55,2	35,3	0,6	14,8	13,3	5,0
Total	1112,1	1353,9	827,0	545,6	207,7	247,3	319,1

^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	1.95%		1.79%	1.86%	1.86%
15-35	1.97%		2.04%	1.87%	1.98%
36-60	-		2.04%	1.74%	1.94%
61-90	-		2.16%	1.85%	1.97%
91-180	2.00%		2.47%	1.72%	1.97%
>180	3.00%		2.74%	2.37%	2.66%
Total	1.98%		2.00%	1.87%	1.95%

^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	05 – 09 jul.				12 - 16 jul.				19 - 23 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	34	107	2940	3047	56	135	5110	5950	47	126	3120	3081
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1968	1673	0	2	2960	1724	0	2	1899	1360
Otros ^c	107	34	419	571	135	54	1612	1988	126	45	503	1068
Total	141	141	5327	5291	191	191	9682	9662	173	173	5522	5509

^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.