

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de agosto de 2021
Fecha de Información: 02 de agosto 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\$1360 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.83%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	275,1	260,1	67,0	107,2	119,6	94,4	73,5
15-35	325,1	471,0	347,1	207,0	31,4	25,6	92,5
36-60	80,4	63,2	50,0	7,2	13,2	73,3	0,0
61-90	4,8	3,8	1,3	0,0	2,6	4,8	0,0
91-180	10,5	6,9	0,0	0,0	6,9	10,5	0,0
>180	4,0	20,8	20,0	0,0	0,8	4,0	0,0
Total	699,9	825,8	485,4	321,4	174,4	212,5	166,0

^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	1.85%	1.98%	-0.42%	1.81%
15-35	1.86%	1.86%	1.77%	1.84%
36-60	—	1.91%	1.71%	1.77%
61-90	—	2.07%	1.73%	1.85%
91-180	—	2.49%	1.82%	2.09%
>180	—	2.47%	2.44%	2.44%
Total	1.86%	1.91%	1.73%	1.83%

^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	02 – 06 ago.				09 - 13 ago.				16 - 20 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	38	135	5071	5452	60	133	3838	4512	23	138	3603	3667
Intragrupo y off-shore ^b	3	0	2741	2188	0	0	2560	1536	0	0	1771	1328
Otros ^c	132	38	846	985	133	60	620	907	138	23	941	1314
Total	173	173	8658	8625	193	193	7018	6955	161	161	6315	6309

^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.