

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2021
Fecha de Información: 06 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\$1498 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.86%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	345,5	380,1	248,7	201,7	61,5	73,9	69,9
15-35	286,8	497,1	336,1	125,5	17,0	17,3	144,0
36-60	20,9	27,9	17,0	1,0	10,9	19,9	0,0
61-90	21,3	6,5	0,0	6,7	6,5	14,6	0,0
91-180	26,5	16,4	0,0	1,3	6,4	15,2	10,0
>180	65,2	78,0	26,4	0,0	1,6	15,2	50,0
Total	766,1	1006,1	628,2	336,2	104,0	156,1	273,9

^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	1.93%	1.62%	1.61%	1.66%
15-35	1.99%	1.92%	1.86%	1.93%
36-60	—	2.05%	1.88%	1.98%
61-90	—	2.11%	1.82%	1.91%
91-180	2.05%	2.32%	1.92%	2.04%
>180	2.56%	2.94%	2.60%	2.68%
Total	2.08%	1.84%	1.75%	1.86%

^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	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	11	34	652	729	72	145	4495	5148	24	192	3895	4249
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	370	301	0	0	2878	1908	0	0	2045	1430
Otros ^c	34	11	79	66	145	72	721	964	192	24	1113	1367
Total	45	45	1101	1096	217	217	8094	8020	216	216	7053	7046

^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.