

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2021
Fecha de Información: 10 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\$1913 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.02%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	442,7	332,3	94,9	296,2	96,6	5,6	140,9
15-35	504,2	761,8	498,0	176,0	24,9	89,4	238,8
36-60	22,9	22,8	0,0	18,7	22,8	4,2	0,0
61-90	11,2	22,9	0,0	0,0	22,9	11,2	0,0
91-180	35,1	4,2	0,0	0,2	4,2	34,9	0,0
>180	82,1	50,5	50,0	0,0	0,5	82,1	0,0
Total	1098,2	1194,6	642,9	491,1	172,0	227,5	379,7

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.97%		2.01%	1.83%	1.92%
15-35	1.97%		2.02%	1.90%	1.98%
36-60	—		2.14%	2.05%	2.10%
61-90	—		2.11%	1.82%	2.01%
91-180	—		2.38%	1.98%	2.02%
>180	—		3.09%	2.58%	2.74%
Total	1.97%		2.08%	1.97%	2.02%

^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	09 – 13 ago.				16 - 20 ago.				23 - 27 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	66	143	4658	5010	30	201	4158	4884	37	144	4548	4307
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2622	2177	0	0	2322	1512	0	0	2349	1103
Otros ^c	143	66	882	905	201	30	1297	1374	144	37	769	2247
Total	209	209	8162	8092	231	231	7777	7770	181	181	7666	7657

^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.