

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2021
Fecha de Información: 11 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\$3003 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.92%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	539,7	319,4	182,3	457,6	117,6	62,5	19,6
15-35	808,1	1067,7	863,2	474,5	23,7	152,8	180,8
36-60	2,6	62,7	3,6	0,0	59,1	2,6	0,0
61-90	30,1	26,6	0,0	0,0	11,8	15,3	14,8
91-180	176,2	72,9	60,0	80,0	7,9	91,2	5,0
>180	63,8	103,4	40,0	0,0	13,4	13,8	50,0
Total	1620,5	1652,8	1149,1	1012,1	233,4	338,1	270,2

^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	1.72%		1.85%	1.67%	1.74%
15-35	2.04%		1.97%	1.81%	1.91%
36-60	—		2.13%	1.76%	2.12%
61-90	2.01%		2.16%	1.92%	2.02%
91-180	2.21%		2.05%	2.02%	2.03%
>180	2.59%		2.66%	2.54%	2.62%
Total	2.12%		1.99%	1.79%	1.92%

^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	64	123	3802	3759	31	214	4198	4986	37	147	4829	4614
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2063	1857	0	0	2392	1537	0	0	2465	1263
Otros ^c	123	64	548	727	214	31	1318	1379	147	37	870	2278
Total	187	187	6413	6343	245	245	7908	7902	184	184	8164	8155

^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.