

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2021
Fecha de Información: 12 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\$3258 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.12%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	530,2	793,1	311,9	388,7	372,1	32,3	109,1
15-35	733,5	821,3	535,6	376,9	46,9	117,8	238,7
36-60	2,8	37,2	0,0	0,0	37,2	2,8	0,0
61-90	14,0	37,9	0,0	0,0	27,9	4,0	10,0
91-180	3,8	70,4	40,0	0,0	30,4	3,8	0,0
>180	456,3	205,4	105,0	0,0	10,4	366,3	90,0
Total	1740,5	1965,2	992,5	765,6	524,8	526,9	447,9

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.94%		1.82%	1.79%	1.82%
15-35	1.92%		2.08%	1.97%	2.00%
36-60	–		2.26%	2.01%	2.24%
61-90	2.09%		2.21%	1.63%	2.13%
91-180	–		2.35%	2.13%	2.32%
>180	2.79%		2.75%	2.86%	2.84%
Total	2.10%		2.01%	2.26%	2.12%

^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	46	87	3071	3392	31	220	4298	5052	41	151	4934	4729
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1656	1516	0	0	2420	1617	0	0	2534	1304
Otros ^c	87	46	823	612	220	31	1341	1384	151	41	877	2303
Total	133	133	5550	5520	251	251	8059	8053	192	192	8345	8336

^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.