

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2021
Fecha de Información: 17 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\$1525 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	518,7	283,0	50,1	304,0	60,2	41,9	172,8
15-35	325,6	624,0	376,5	83,9	61,7	56,0	185,8
36-60	9,4	9,0	0,0	0,0	6,5	6,9	2,5
61-90	17,2	20,6	0,0	0,0	10,6	7,2	10,0
91-180	11,2	56,5	17,0	0,0	34,5	6,2	5,0
>180	8,5	24,6	15,0	0,0	2,4	1,2	7,3
Total	890,7	1017,7	458,5	387,9	175,8	119,4	383,4

^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	2.10%	2.00%	1.73%	1.88%
15-35	2.01%	2.15%	1.97%	2.08%
36-60	2.12%	2.43%	1.58%	2.01%
61-90	2.09%	2.25%	1.89%	2.10%
91-180	2.09%	2.40%	2.13%	2.33%
>180	2.85%	2.96%	2.40%	2.90%
Total	2.07%	2.17%	1.80%	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	16 – 20 ago.				23 - 27 ago.				30 ago. - 03 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	35	235	5009	5568	45	153	5340	5164	17	179	3344	4333
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2768	2121	0	0	2623	1482	0	0	2892	1540
Otros ^c	235	35	1414	1496	153	45	1009	2316	179	17	513	841
Total	270	270	9191	9185	198	198	8972	8962	196	196	6749	6714

^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.