

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2021
Fecha de Información: 18 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\$2995 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.11%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	620,0	350,8	65,8	494,9	218,0	58,1	67,0
15-35	805,4	874,1	593,9	460,5	55,1	119,8	225,1
36-60	53,4	30,3	2,1	23,0	23,2	25,4	5,0
61-90	16,7	18,2	5,0	0,0	13,2	16,7	0,0
91-180	78,4	144,8	48,0	0,0	36,8	18,4	60,0
>180	182,7	207,1	168,0	0,0	9,1	152,7	30,0
Total	1756,7	1625,3	882,8	978,5	355,4	391,1	387,1

^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	2.04%	2.23%	1.80%	1.97%
15-35	2.04%	2.05%	2.03%	2.04%
36-60	2.10%	2.04%	1.98%	2.01%
61-90	—	2.07%	1.95%	2.01%
91-180	2.23%	2.21%	1.92%	2.18%
>180	2.64%	2.80%	2.61%	2.70%
Total	2.12%	2.22%	2.01%	2.11%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	128	4135	4459	47	165	5482	5216	22	180	3466	4407
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2213	1939	0	0	2625	1577	0	0	2892	1594
Otros ^c	128	25	1134	1083	165	47	1014	2319	180	22	574	895
Total	153	153	7482	7481	212	212	9121	9112	202	202	6932	6896

^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.