

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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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.