

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2021
Fecha de Información: 19 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\$2711 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.90%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	529,3	385,0	95,6	333,3	171,0	77,6	118,4
15-35	524,9	1122,2	850,7	242,3	53,1	64,2	218,4
36-60	126,6	7,8	0,0	19,0	7,8	107,7	0,0
61-90	73,5	34,0	0,0	40,0	9,0	8,5	25,0
91-180	78,4	64,5	49,8	0,0	12,8	76,4	1,9
>180	86,2	67,2	35,0	0,0	7,2	61,2	25,0
Total	1418,8	1680,6	1031,0	634,5	260,8	395,5	388,8

^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	2.26%	0.93%	1.92%	1.64%
15-35	1.95%	1.99%	1.93%	1.97%
36-60	—	2.14%	2.00%	2.01%
61-90	2.10%	2.23%	1.99%	2.05%
91-180	2.25%	2.11%	2.06%	2.08%
>180	2.39%	2.46%	2.44%	2.43%
Total	2.09%	1.76%	1.99%	1.90%

^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 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	20	72	3321	3601	47	169	5584	5407	22	180	3604	4491
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1763	1667	0	0	2693	1668	0	0	2902	1704
Otros ^c	72	20	908	722	169	47	1132	2324	180	22	639	915
Total	92	92	5992	5990	216	216	9409	9399	202	202	7145	7110

^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.