

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2021
Fecha de Información: 23 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\$1958 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.13%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	169,3	144,9	78,7	68,5	46,6	81,3	19,5
15-35	774,6	1034,2	234,2	97,3	204,0	81,3	596,0
36-60	107,3	164,0	60,5	35,0	33,6	2,3	70,0
61-90	1,1	5,4	0,0	0,0	5,4	1,1	0,0
91-180	192,5	99,9	0,0	10,1	19,9	102,4	80,0
>180	28,7	21,7	0,0	0,0	1,7	8,7	20,0
Total	1273,6	1470,0	373,5	210,9	311,1	277,2	785,5

^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	1.99%		1.78%	1.83%	1.83%
15-35	2.22%		2.14%	1.81%	2.14%
36-60	2.26%		2.32%	1.71%	2.28%
61-90	—		2.49%	2.19%	2.44%
91-180	2.24%		2.49%	2.20%	2.24%
>180	2.73%		2.96%	2.20%	2.59%
Total	2.23%		2.13%	1.93%	2.13%

^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	23 – 27 ago.				30 ago. - 03 sept.				06 - 10 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	50	183	5788	5928	24	182	3734	4597	23	101	3598	4417
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2942	1757	0	0	2908	1776	0	0	2578	1403
Otros ^c	183	50	1385	2420	182	24	699	933	101	23	840	726
Total	233	233	10115	10105	206	206	7341	7306	124	124	7016	6546

^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.