

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2021
Fecha de Información: 24 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\$2881 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.26%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	612,5	631,9	165,7	420,2	306,6	32,7	159,6
15-35	593,9	520,6	398,0	490,1	38,0	19,1	84,6
36-60	8,8	82,1	50,0	5,0	32,1	3,8	0,0
61-90	14,2	12,4	0,0	0,0	10,1	12,0	2,2
91-180	2,9	18,8	10,0	0,0	8,8	2,9	0,0
>180	315,4	325,8	307,0	10,0	7,2	293,8	11,5
Total	1547,6	1591,6	930,8	925,3	402,8	364,3	258,0

^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	2.56%		2.13%	2.00%	2.15%
15-35	2.21%		2.23%	2.21%	2.22%
36-60	—		2.37%	1.76%	2.30%
61-90	2.22%		2.41%	2.12%	2.25%
91-180	—		2.39%	2.07%	2.35%
>180	2.41%		2.43%	2.62%	2.54%
Total	2.43%		2.24%	2.25%	2.26%

^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	149	5944	5925	25	183	3797	4685	24	103	3653	4452
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2797	2008	0	0	2951	1828	0	0	2665	1423
Otros ^c	149	50	1483	2283	183	25	731	931	103	24	754	725
Total	199	199	10224	10216	208	208	7479	7444	127	127	7072	6600

^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.