

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2021
Fecha de Información: 27 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\$2994 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.60%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	273,1	127,8	40,0	165,5	19,8	39,6	68,0
15-35	598,8	1204,2	198,1	312,0	763,2	43,9	242,9
36-60	42,8	36,9	0,0	1,0	36,9	41,8	0,0
61-90	476,0	37,8	3,0	0,0	34,8	476,0	0,0
91-180	292,5	152,1	50,0	15,2	27,1	202,3	75,0
>180	39,4	123,7	80,0	0,0	18,7	14,4	25,0
Total	1722,5	1682,5	371,1	493,7	900,6	817,9	410,9

^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	1.21%	1.97%	1.44%	1.50%
15-35	2.01%	1.10%	1.70%	1.39%
36-60	—	2.30%	2.02%	2.15%
61-90	—	2.38%	1.61%	1.66%
91-180	2.10%	2.27%	1.96%	2.05%
>180	2.32%	2.27%	2.46%	2.30%
Total	1.91%	1.39%	1.70%	1.60%

^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	23 – 27 ago.				30 ago. - 03 sep.				06 - 10 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	14	35	1905	1847	36	111	4282	5001	31	147	3747	4529
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	737	776	0	0	3051	2231	0	0	2724	1452
Otros ^c	35	14	614	629	111	36	761	827	147	31	714	733
Total	49	49	3256	3252	147	147	8094	8059	178	178	7185	6714

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.