

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 30 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\$2670 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.99%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	711,2	313,2	37,0	518,4	203,2	119,9	73,0
15-35	459,4	803,1	432,8	279,0	245,8	56,0	124,5
36-60	25,4	61,6	0,0	20,0	60,3	4,2	1,3
61-90	35,8	37,5	0,0	0,0	37,5	35,8	0,0
91-180	299,6	88,0	20,0	50,0	53,0	234,6	15,0
>180	18,0	30,6	8,0	3,5	22,6	14,5	0,0
Total	1549,4	1334,1	497,8	870,9	622,5	464,9	213,7

^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	2.07%		1.93%	1.63%	1.76%
15-35	2.05%		2.08%	2.00%	2.05%
36-60	2.08%		2.26%	2.01%	2.19%
61-90	—		2.33%	2.04%	2.19%
91-180	2.10%		2.29%	2.07%	2.12%
>180	—		3.03%	2.69%	2.88%
Total	2.06%		2.10%	1.87%	1.99%

^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	30 ago. - 03 sep.				06 - 10 sep.				13 - 17 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	42	118	4915	5233	36	148	3785	4616	58	142	5199	6373
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3088	2714	0	0	2735	1467	0	0	3883	1651
Otros ^c	118	42	902	924	148	36	770	736	142	58	915	1936
Total	160	160	8905	8871	184	184	7290	6819	200	200	9997	9960

^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.