

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$3683 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%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	1060,5	172,3	13,6	904,3	29,7	27,2	129,0
15-35	730,6	1028,8	781,0	533,5	75,5	24,8	172,3
36-60	15,4	35,2	3,0	0,0	27,2	10,4	5,0
61-90	18,2	30,6	0,0	0,0	30,6	18,2	0,0
91-180	223,6	573,9	343,1	30,3	58,0	20,6	172,8
>180	42,6	272,3	211,5	0,0	18,6	0,4	42,2
Total	2090,9	2113,0	1352,1	1468,2	239,6	101,4	521,2

^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	2.06%		1.94%	1.35%	1.52%
15-35	2.00%		1.92%	1.93%	1.94%
36-60	2.04%		2.13%	1.85%	2.05%
61-90	—		2.29%	2.01%	2.18%
91-180	2.16%		2.24%	2.33%	2.22%
>180	2.75%		2.57%	2.73%	2.61%
Total	2.13%		2.09%	1.61%	1.93%

^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 sept.				06 - 10 sept.				13 - 17 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	23	89	3669	3513	38	156	4027	4786	60	147	5695	6640
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2306	2482	0	0	2753	1587	0	0	4020	2026
Otros ^c	89	23	294	252	156	38	811	748	147	60	942	1951
Total	112	112	6269	6247	194	194	7591	7121	207	207	10657	10617

^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.