

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de agosto de 2021
Fecha de Información: 05 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\$1459 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.71%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	359,0	296,7	93,9	209,1	85,5	32,6	117,3
15-35	239,0	416,4	287,4	163,6	68,5	14,9	60,5
36-60	32,6	14,4	0,0	1,8	14,4	30,9	0,0
61-90	132,8	73,2	65,0	50,0	7,4	82,0	0,8
91-180	9,5	31,1	0,0	0,0	29,5	7,9	1,6
>180	20,8	18,2	12,4	10,0	0,8	5,8	5,0
Total	793,8	850,0	458,7	434,4	206,1	174,1	185,3

^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	1.91%	0.53%	1.66%	1.42%
15-35	1.89%	1.89%	1.85%	1.89%
36-60	—	2.02%	1.83%	1.89%
61-90	1.80%	2.04%	1.68%	1.71%
91-180	1.97%	2.35%	2.01%	2.26%
>180	2.36%	2.45%	2.93%	2.75%
Total	1.92%	1.58%	1.77%	1.71%

^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	02 – 06 ago.				09 - 13 ago.				16 - 20 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	59	2960	3170	63	137	4335	4982	24	139	3790	4113
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1849	1513	0	0	2752	1837	0	0	1990	1379
Otros ^c	59	22	248	364	137	63	712	916	139	24	1059	1342
Total	81	81	5057	5047	200	200	7799	7735	163	163	6839	6834

^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.