

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2021
Fecha de Información: 13 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\$2571 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.87%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	550,7	680,9	418,2	346,2	155,8	97,6	106,9
15-35	755,7	483,5	259,1	506,0	60,0	85,3	164,4
36-60	7,4	30,4	0,0	0,0	30,4	7,4	0,0
61-90	31,2	89,7	36,4	0,0	48,3	26,2	5,0
91-180	61,9	179,6	90,3	15,0	43,3	0,9	46,0
>180	14,7	7,6	0,0	0,0	7,6	14,6	0,0
Total	1421,6	1471,6	804,0	867,2	345,4	232,1	322,3

^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	1.77%	1.75%	1.39%	1.61%
15-35	2.02%	2.11%	1.83%	1.96%
36-60	—	2.41%	1.93%	2.32%
61-90	2.07%	2.15%	2.06%	2.12%
91-180	2.11%	2.32%	2.14%	2.22%
>180	—	2.88%	2.71%	2.77%
Total	1.95%	2.00%	1.70%	1.87%

^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	09 – 13 ago.				16 - 20 ago.				23 - 27 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	12	61	1230	1380	33	227	4625	5526	44	153	5124	4891
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	465	616	0	0	2766	1794	0	0	2579	1457
Otros ^c	61	12	667	361	227	33	1411	1477	153	44	962	2307
Total	73	73	2362	2357	260	260	8802	8797	197	197	8665	8655

^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.