

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2021
Fecha de Información: 26 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\$2498 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.89%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	462,7	236,2	81,9	344,1	50,8	15,1	103,5
15-35	554,2	940,6	379,5	302,8	344,6	34,9	216,5
36-60	4,7	5,0	0,0	0,0	5,0	4,7	0,0
61-90	114,6	70,8	55,0	0,0	5,8	104,6	10,0
91-180	242,3	42,6	10,0	20,0	12,6	202,3	20,0
>180	67,0	117,6	102,0	13,4	5,6	43,6	10,0
Total	1445,5	1412,7	628,4	680,3	424,4	405,2	360,0

^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	2.07%	1.54%	2.01%	1.90%
15-35	1.93%	1.72%	1.66%	1.75%
36-60	—	2.36%	1.98%	2.17%
61-90	2.03%	2.35%	2.04%	2.06%
91-180	2.10%	2.30%	2.03%	2.06%
>180	2.63%	2.28%	2.53%	2.37%
Total	2.00%	1.79%	1.94%	1.89%

^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	23	46	4325	4310	34	105	3992	4887	25	143	3727	4515
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1935	1973	0	0	3015	2031	0	0	2720	1438
Otros ^c	46	23	1090	1058	105	34	747	802	143	25	709	732
Total	69	69	7350	7341	139	139	7754	7720	168	168	7156	6685

^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.