

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 31 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\$2491 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.88%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	391,7	271,7	137,9	295,8	48,9	10,9	85,0
15-35	666,1	519,5	282,0	447,5	49,5	30,7	188,0
36-60	13,8	91,5	40,0	2,0	41,5	1,8	10,0
61-90	189,0	50,2	0,4	0,0	49,9	189,0	0,0
91-180	246,1	323,9	135,0	99,5	58,7	16,4	130,2
>180	76,6	108,7	31,7	24,6	32,1	7,0	45,0
Total	1583,3	1365,6	626,9	869,4	280,5	255,7	458,2

^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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.87%		1.49%	1.57%	1.60%
15-35	1.92%		1.99%	1.83%	1.90%
36-60	1.97%		2.25%	1.82%	2.17%
61-90	-		1.98%	1.82%	1.86%
91-180	2.29%		1.76%	2.05%	1.98%
>180	2.41%		2.79%	2.79%	2.60%
Total	2.07%		1.86%	1.78%	1.88%

^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.

¹A 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.

²El 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	37	104	4499	4705	37	153	3856	4658	60	145	5329	6558
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2980	2802	0	0	2752	1527	0	0	4020	1738
Otros ^c	104	37	637	574	153	37	795	747	145	60	928	1944
Total	141	141	8116	8081	190	190	7403	6932	205	205	10277	10240

^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.