

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 02 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\$3021 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.11%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	509,3	211,7	29,0	302,4	43,8	68,1	138,9
15-35	1080,8	633,6	417,6	844,2	70,0	90,7	146,0
36-60	23,0	31,7	0,0	0,0	30,7	22,0	1,0
61-90	14,7	25,8	0,0	0,3	13,3	2,0	12,5
91-180	16,1	436,3	418,0	0,0	13,3	11,1	5,0
>180	83,3	278,0	255,0	54,7	3,0	8,6	20,0
Total	1727,2	1617,0	1119,6	1201,5	174,0	202,3	323,4

^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	2.02%		1.87%	1.98%	1.97%
15-35	2.03%		2.06%	2.00%	2.03%
36-60	2.17%		2.22%	2.12%	2.18%
61-90	2.06%		2.20%	2.04%	2.12%
91-180	2.26%		2.28%	2.35%	2.29%
>180	2.64%		2.65%	2.63%	2.64%
Total	2.06%		2.19%	2.05%	2.11%

^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 sep.				06 - 10 sep.				13 - 17 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	68	2751	2609	41	155	4237	4909	60	148	5848	6746
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1655	1788	0	0	2756	1679	0	0	4030	2162
Otros ^c	68	22	253	252	155	41	819	753	148	60	1026	1956
Total	90	90	4659	4649	196	196	7812	7341	208	208	10904	10864

^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.