

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 03 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\$3007 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.04%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	735,1	354,7	26,9	393,1	5,3	19,5	322,5
15-35	791,3	877,9	553,0	480,6	38,9	24,7	286,0
36-60	8,6	80,4	0,0	0,2	77,7	5,6	2,7
61-90	102,1	66,0	0,0	0,0	2,5	38,6	63,5
91-180	339,7	473,3	150,0	5,3	13,0	24,2	310,2
>180	61,7	137,1	100,0	7,0	1,6	19,2	35,5
Total	2038,6	1989,4	829,9	886,2	138,9	131,9	1020,5

^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	1.99%		1.76%	1.83%	1.90%
15-35	2.02%		2.04%	1.97%	2.02%
36-60	2.06%		2.13%	1.82%	2.11%
61-90	1.94%		2.53%	2.03%	1.99%
91-180	2.15%		2.20%	2.38%	2.17%
>180	2.72%		2.58%	2.79%	2.72%
Total	2.07%		2.08%	1.95%	2.04%

^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

Sector	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	12	23	394	422	44	156	4584	5143	60	148	6131	6830
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	215	224	0	0	2772	1797	0	0	4041	2365
Otros ^c	23	12	126	88	156	44	819	763	148	60	1027	1963
Total	35	35	735	734	200	200	8175	7703	208	208	11199	11158

^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.