

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 06 de septiembre de 2021<sup>1</sup>**

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\$354 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.90%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	122,9	98,4	67	87	1,4	5,9	30
15-35	100,8	120,7	33	2	2,7	13,8	85
36-60	12,9	10,5	0	0	0,5	2,9	10
61-90	0,1	0,3	0	0	0,3	0,1	0
91-180	0,4	5,0	0	0	5,0	0,4	0
>180	2,0	5,0	0	0	5,0	2,0	0
<b>Total</b>	<b>239,2</b>	<b>239,9</b>	<b>100</b>	<b>89</b>	<b>14,9</b>	<b>25,2</b>	<b>125</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.80%		1.95%	1.90%	1.88%
15-35	1.69%		2.02%	1.82%	1.79%
36-60	2.18%		2.34%	2.05%	2.16%
61-90	-		2.55%	1.47%	2.18%
91-180	-		2.46%	2.25%	2.44%
>180	-		3.24%	3.73%	3.38%
<b>Total</b>	<b>1.76%</b>		<b>2.12%</b>	<b>1.95%</b>	<b>1.90%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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	06 – 10 sept.				13 - 17 sept.				20 - 24 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	47	161	4710	5162	56	148	6206	6908	21	126	4676	5807
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2794	1927	0	0	4089	2410	0	0	2734	2259
Otros <sup>c</sup>	161	47	816	760	148	56	1026	1963	126	21	1755	1080
<b>Total</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>8320</b>	<b>7849</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>11321</b>	<b>11281</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>9165</b>	<b>9146</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.