

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 07 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\$4353 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.09%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	1245,5	709,4	139,4	581,1	293,9	388,4	276,0
15-35	641,1	726,0	421,2	369,0	105,8	73,1	199,0
36-60	155,6	482,9	4,1	27,0	366,9	16,6	112,0
61-90	59,4	312,4	261,5	24,6	20,9	4,8	30,0
91-180	19,2	150,9	145,0	0,0	5,5	18,7	0,4
>180	330,3	201,0	83,0	2,5	55,0	264,8	63,0
Total	2451,1	2582,6	1054,3	1004,2	847,9	766,5	680,4

^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	1.98%		1.85%	1.87%	1.88%
15-35	2.03%		2.07%	1.88%	2.03%
36-60	1.99%		2.28%	2.16%	2.21%
61-90	2.30%		2.46%	2.33%	2.35%
91-180	2.38%		2.35%	2.47%	2.37%
>180	2.94%		2.98%	2.57%	2.69%
Total	2.10%		2.13%	2.05%	2.09%

^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	06 – 10 sep.				13 - 17 sep.				20 - 24 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	50	164	5574	5522	58	149	6465	7164	21	126	4789	5906
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2865	2244	0	0	4104	2604	0	0	2759	2320
Otros ^c	164	50	921	1123	149	58	1216	1979	126	21	1808	1110
Total	214	214	9360	8889	207	207	11785	11747	147	147	9356	9336

^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.