

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 13 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\$3571 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.09%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	623,0	771,0	427,7	572,5	337,4	44,5	6,0
15-35	535,2	754,8	628,6	411,5	16,8	14,3	109,4
36-60	16,1	93,7	60,0	0,0	21,7	4,1	12,0
61-90	10,3	20,5	0,0	0,0	17,5	7,3	3,0
91-180	302,8	348,6	285,1	45,0	17,9	212,3	45,5
>180	195,8	90,5	72,4	51,3	3,1	129,5	15,0
Total	1683,2	2079,1	1473,9	1080,3	414,4	412,0	190,9

^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	2.05%		1.92%	1.48%	1.76%
15-35	2.13%		2.09%	2.08%	2.09%
36-60	2.22%		2.12%	2.06%	2.13%
61-90	2.32%		2.39%	2.21%	2.34%
91-180	2.56%		2.42%	2.44%	2.44%
>180	2.92%		2.91%	2.56%	2.68%
Total	2.30%		2.11%	2.03%	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	13 – 17 sep.				20 - 24 sep.				27 sep. - 01 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	48	168	7657	8577	28	128	5099	6341	28	121	3794	4531
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4586	3588	0	0	3126	2562	0	0	2644	1751
Otros ^c	168	48	2038	2076	128	28	1842	1145	121	28	673	782
Total	216	216	14281	14241	156	156	10067	10048	149	149	7111	7064

^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.