

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 14 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\$3118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.02%<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         | 517,6                          | 352,7         | 211,4                                | 406,7         | 62,5          | 32,1         | 78,8                                 |
| 15-35        | 951,9                          | 778,6         | 445,6                                | 613,0         | 46,7          | 52,6         | 286,2                                |
| 36-60        | 40,8                           | 40,2          | 13,2                                 | 11,8          | 6,9           | 9,0          | 20,0                                 |
| 61-90        | 148,9                          | 57,5          | 0,2                                  | 2,0           | 45,9          | 135,5        | 11,4                                 |
| 91-180       | 193,5                          | 392,3         | 240,0                                | 48,0          | 12,3          | 5,5          | 140,0                                |
| >180         | 59,3                           | 167,4         | 116,5                                | 1,6           | 4,9           | 11,7         | 46,0                                 |
| <b>Total</b> | <b>1912,1</b>                  | <b>1788,6</b> | <b>1026,9</b>                        | <b>1083,1</b> | <b>179,2</b>  | <b>246,5</b> | <b>582,4</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         | 2.20%   |  | 2.07%                        | 1.72%        | 1.89%        |
| 15-35        | 2.02%   |  | 2.05%                        | 1.77%        | 1.93%        |
| 36-60        | 2.20%   |  | 2.23%                        | 2.02%        | 2.16%        |
| 61-90        | 2.34%   |  | 2.41%                        | 2.23%        | 2.28%        |
| 91-180       | 2.34%   |  | 2.15%                        | 2.33%        | 2.23%        |
| >180         | 2.56%   |  | 2.70%                        | 2.74%        | 2.65%        |
| <b>Total</b> | <b>2.18%</b>                                      |  | <b>2.13%</b>                 | <b>1.83%</b> | <b>2.02%</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                            | 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 <sup>a</sup>      | 25           | 142        | 4800        | 5198        | 30           | 129        | 5231         | 6485         | 28                | 120        | 3848        | 4651        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 2657        | 2205        | 0            | 0          | 3239         | 2669         | 0                 | 0          | 2714        | 1773        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 142          | 25         | 1017        | 1035        | 129          | 30         | 1849         | 1146         | 120               | 28         | 702         | 784         |
| <b>Total</b>                        | <b>167</b>   | <b>167</b> | <b>8474</b> | <b>8438</b> | <b>159</b>   | <b>159</b> | <b>10319</b> | <b>10300</b> | <b>148</b>        | <b>148</b> | <b>7264</b> | <b>7208</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.