

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 17 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\$1146 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.20%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	156,8	117,7	32,0	56	11,7	26,8	74,0
15-35	322,9	363,2	191,2	150	18,9	19,9	153,0
36-60	19,3	4,2	0,0	0	4,2	19,3	0,0
61-90	49,3	82,9	10,0	0	47,9	24,3	25,0
91-180	31,1	133,5	102,0	10	11,3	0,9	20,2
>180	79,3	128,3	50,0	2	8,3	7,3	70,0
Total	658,7	829,7	385,2	218	102,3	98,6	342,2

^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	2.10%		1.41%	1.45%	1.73%
15-35	2.09%		2.11%	2.03%	2.09%
36-60	-		2.49%	2.07%	2.14%
61-90	2.28%		2.35%	2.24%	2.31%
91-180	2.39%		2.46%	2.36%	2.43%
>180	3.15%		3.59%	3.19%	3.24%
Total	2.34%		2.21%	1.93%	2.20%

^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	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	5	35	368	457	29	132	5849	6815	31	123	3927	4934
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	237	160	0	0	3433	3108	0	0	2962	1798
Otros ^c	35	5	102	89	132	29	1858	1197	123	31	708	802
Total	40	40	707	706	161	161	11140	11120	154	154	7597	7534

^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.