INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 23 de septiembre de 2021[1]

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$1656 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.22%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	268,7	149,4	66,0	175,6	17,1	26,8	66,3
15-35	665,3	757,6	344,0	139,7	29,3	141,3	384,3
36-60	1,8	15,4	10,6	0,0	4,8	1,8	0,0
61-90	45,8	83,2	20,0	16,2	48,2	14,6	15,0
91-180	15,6	7,8	0,0	0,0	7,8	15,6	0,0
>180	61,7	94,1	40,0	10,0	9,0	6,5	45,2
Total	**1059,0**	**1107,7**	**480,6**	**341,5**	**116,3**	**206,7**	**510,8**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	2.30%	2.32%	1.98%	2.16%
15-35	2.26%	1.84%	2.22%	2.11%
36-60	–	3.19%	2.06%	2.88%
61-90	2.32%	2.41%	2.36%	2.39%
91-180	–	2.74%	2.51%	2.59%
>180	3.06%	2.98%	3.09%	3.03%
Total	**2.34%**	**2.10%**	**2.21%**	**2.22%**

[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.

[1] 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.

[2] 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	20 – 24 sep.				27 sep. - 01 oct.				04 - 08 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	11	66	2989	3111	48	127	4176	5167	37	102	5162	5157
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1752	1873	0	0	3042	1899	0	0	3072	2625
Otros[c]	66	11	593	350	127	48	735	817	102	37	513	907
Total	**77**	**77**	**5334**	**5334**	**175**	**175**	**7953**	**7883**	**139**	**139**	**8747**	**8689**

[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.