

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 28 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\$2174 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.41%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

| Rango        | Sector Financiero <sup>b</sup> |               | Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup> |              | Otros Agentes |              | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                             | Ventas       | Compras       | Ventas       | Mercado Cambiario  |
| 3-14         | 411,3                          | 615,0         | 129,3                               | 151,8        | 268,7         | 42,4         | 217,0              |
| 15-35        | 446,2                          | 613,2         | 319,7                               | 212,8        | 96,9          | 36,9         | 196,5              |
| 36-60        | 306,0                          | 77,5          | 46,0                                | 63,0         | 21,4          | 232,9        | 10,1               |
| 61-90        | 7,0                            | 18,7          | 0,0                                 | 0,0          | 18,7          | 7,0          | 0,0                |
| 91-180       | 26,4                           | 42,0          | 25,0                                | 0,0          | 7,0           | 16,4         | 10,0               |
| >180         | 12,6                           | 42,4          | 30,0                                | 0,0          | 1,4           | 1,6          | 11,0               |
| <b>Total</b> | <b>1209,5</b>                  | <b>1408,8</b> | <b>550,0</b>                        | <b>427,6</b> | <b>414,2</b>  | <b>337,3</b> | <b>444,6</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         | 2.53%                                             | 2.38%                        | 1.48%        | 2.29%        |
| 15-35        | 2.45%                                             | 2.45%                        | 2.47%        | 2.45%        |
| 36-60        | 2.47%                                             | 2.53%                        | 2.45%        | 2.46%        |
| 61-90        | —                                                 | 2.63%                        | 2.35%        | 2.55%        |
| 91-180       | 2.55%                                             | 2.65%                        | 2.47%        | 2.57%        |
| >180         | 2.94%                                             | 3.10%                        | 2.90%        | 3.05%        |
| <b>Total</b> | <b>2.50%</b>                                      | <b>2.45%</b>                 | <b>2.27%</b> | <b>2.41%</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                            | 27 sep. - 01 oct. |            |             |             | 04 - 08 oct. |            |             |             | 11 - 15 oct. |            |             |             |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
|                                     | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery     |            | NDF         |             | Delivery     |            | NDF         |             |
|                                     | C                 | V          | C           | V           | C            | V          | C           | V           | C            | V          | C           | V           |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 45                | 135        | 4376        | 5199        | 51           | 107        | 5713        | 5842        | 41           | 114        | 3972        | 4201        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0                 | 0          | 3183        | 2266        | 0            | 0          | 3193        | 2813        | 0            | 0          | 2516        | 1708        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 135               | 45         | 763         | 799         | 107          | 51         | 757         | 921         | 114          | 41         | 603         | 997         |
| <b>Total</b>                        | <b>180</b>        | <b>180</b> | <b>8322</b> | <b>8264</b> | <b>158</b>   | <b>158</b> | <b>9663</b> | <b>9576</b> | <b>155</b>   | <b>155</b> | <b>7091</b> | <b>6906</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.