

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 06 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\$354 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.90%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	122,9	98,4	67	87	1,4	5,9	30
15-35	100,8	120,7	33	2	2,7	13,8	85
36-60	12,9	10,5	0	0	0,5	2,9	10
61-90	0,1	0,3	0	0	0,3	0,1	0
91-180	0,4	5,0	0	0	5,0	0,4	0
>180	2,0	5,0	0	0	5,0	2,0	0
Total	239,2	239,9	100	89	14,9	25,2	125

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.80%		1.95%	1.90%	1.88%
15-35	1.69%		2.02%	1.82%	1.79%
36-60	2.18%		2.34%	2.05%	2.16%
61-90	—		2.55%	1.47%	2.18%
91-180	—		2.46%	2.25%	2.44%
>180	—		3.24%	3.73%	3.38%
Total	1.76%		2.12%	1.95%	1.90%

^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: ((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

Sectores	06 - 10 sept.				13 - 17 sept.				20 - 24 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	161	4710	5162	56	148	6206	6908	21	126	4676	5807
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2794	1927	0	0	4089	2410	0	0	2734	2259
Otros ^c	161	47	816	760	148	56	1026	1963	126	21	1755	1080
Total	208	208	8320	7849	204	204	11321	11281	147	147	9165	9146

^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.