

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 08 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\$2990 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.21%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	753,0	483,7	89,5	611,8	341,7	88,7	52,5
15-35	311,2	710,7	559,1	174,3	84,0	69,4	67,6
36-60	24,1	21,0	0,0	20,0	21,0	4,1	0,0
61-90	47,2	21,9	0,3	10,0	4,6	20,2	17,0
91-180	196,5	315,4	300,0	0,0	3,4	184,5	12,0
>180	180,9	79,6	70,0	7,0	3,9	168,1	5,8
Total	1512,8	1632,4	1019,0	823,0	458,6	534,9	154,8

^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

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.98%	1.87%	1.76%	1.81%
15-35	1.99%	2.90%	1.97%	2.62%
36-60	—	2.34%	2.03%	2.17%
61-90	1.12%	2.49%	2.13%	1.76%
91-180	1.10%	2.32%	2.20%	2.24%
>180	2.52%	2.88%	2.73%	2.73%
Total	1.84%	2.44%	2.02%	2.21%

^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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	06 – 10 sep.				13 - 17 sep.				20 - 24 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	34	94	5115	4827	58	148	6799	7573	21	126	4897	5923
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2429	2062	0	0	4169	2901	0	0	2760	2390
Otros ^c	94	34	816	1001	148	58	1555	2009	126	21	1807	1132
Total	128	128	8360	7890	206	206	12523	12483	147	147	9464	9445

^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.