

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 09 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\$2112 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.05%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	425,5	242,9	91,8	297,9	85,7	62,1	65,5
15-35	352,7	623,6	418,4	199,1	101,6	50,1	103,5
36-60	12,0	43,6	0,0	0,0	43,6	12,0	0,0
61-90	89,1	72,2	0,0	0,0	2,2	19,1	70,0
91-180	157,4	138,0	70,0	0,3	8,0	97,2	60,0
>180	94,8	218,5	157,0	31,7	1,5	3,1	60,0
Total	1131,7	1338,9	737,2	528,9	242,6	243,7	359,0

^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	2.07%		1.98%	3.79%	1.74%
15-35	2.06%		2.08%	2.00%	2.06%
36-60	—		2.20%	2.14%	2.19%
61-90	2.21%		2.47%	2.21%	2.22%
91-180	2.38%		2.33%	2.26%	2.32%
>180	2.73%		2.93%	3.15%	2.84%
Total	2.26%		2.15%	1.81%	2.05%

^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	25	58	3126	3148	60	156	7035	7758	21	125	4907	5986
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1859	1668	0	0	4230	3092	0	0	2812	2390
Otros ^c	58	25	683	851	156	60	1640	2015	125	21	1808	1131
Total	83	83	5668	5667	216	216	12905	12865	146	146	9527	9507

^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.