

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 10 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\$1878 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.14%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	185,6	396,1	228,5	94,9	115,1	38,1	52,5
15-35	478,9	402,5	227,0	274,3	29,0	58,1	146,5
36-60	63,0	39,9	0,0	0,0	39,9	63,0	0,0
61-90	17,6	5,4	1,9	15,0	3,5	2,6	0,0
91-180	197,6	247,6	203,9	145,0	33,7	42,6	10,0
>180	31,4	31,8	20,0	1,7	1,8	19,7	10,0
Total	974,0	1123,2	681,3	530,9	222,9	224,1	219,0

^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	2.11%		1.85%	1.99%	1.93%
15-35	2.15%		2.24%	2.01%	2.12%
36-60	—		2.32%	2.02%	2.14%
61-90	—		2.47%	1.34%	1.69%
91-180	2.26%		2.32%	2.21%	2.28%
>180	2.58%		3.01%	4.83%	4.05%
Total	2.17%		2.11%	2.17%	2.14%

^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 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	13	32	650	690	45	160	7219	8126	24	127	4918	6008
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	82	65	0	0	4459	3198	0	0	2823	2390
Otros ^c	32	13	530	508	160	45	1733	2047	127	24	1813	1136
Total	45	45	1262	1263	205	205	13411	13371	151	151	9554	9534

^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.