

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 14 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\$3118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.02%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	517,6	352,7	211,4	406,7	62,5	32,1	78,8
15-35	951,9	778,6	445,6	613,0	46,7	52,6	286,2
36-60	40,8	40,2	13,2	11,8	6,9	9,0	20,0
61-90	148,9	57,5	0,2	2,0	45,9	135,5	11,4
91-180	193,5	392,3	240,0	48,0	12,3	5,5	140,0
>180	59,3	167,4	116,5	1,6	4,9	11,7	46,0
Total	1912,1	1788,6	1026,9	1083,1	179,2	246,5	582,4

^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	2.20%		2.07%	1.72%	1.89%
15-35	2.02%		2.05%	1.77%	1.93%
36-60	2.20%		2.23%	2.02%	2.16%
61-90	2.34%		2.41%	2.23%	2.28%
91-180	2.34%		2.15%	2.33%	2.23%
>180	2.56%		2.70%	2.74%	2.65%
Total	2.18%		2.13%	1.83%	2.02%

^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	13 – 17 sep.				20 - 24 sep.				27 sep. - 01 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	142	4800	5198	30	129	5231	6485	28	120	3848	4651
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2657	2205	0	0	3239	2669	0	0	2714	1773
Otros ^c	142	25	1017	1035	129	30	1849	1146	120	28	702	784
Total	167	167	8474	8438	159	159	10319	10300	148	148	7264	7208

^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.