

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 15 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\$2528 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.09%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	622,9	456,2	101,6	514,2	259,6	13,7	95,0
15-35	322,8	829,3	681,4	174,5	30,6	31,0	117,3
36-60	4,0	16,9	0,0	0,0	16,9	4,0	0,0
61-90	170,2	24,0	0,0	0,0	22,2	168,4	1,9
91-180	155,3	46,2	20,0	0,0	4,8	133,9	21,4
>180	46,4	114,4	65,0	0,0	4,4	1,4	45,0
Total	1321,6	1487,1	868,0	688,7	338,6	352,4	280,5

^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	2.16%		2.12%	1.87%	1.99%
15-35	2.10%		2.10%	1.98%	2.08%
36-60	—		2.28%	2.06%	2.24%
61-90	2.12%		2.41%	2.21%	2.23%
91-180	2.29%		2.35%	2.17%	2.21%
>180	2.74%		2.74%	3.24%	2.75%
Total	2.24%		2.14%	2.00%	2.09%

^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	20	112	4353	4852	30	129	5467	6546	28	123	3856	4874
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2387	2207	0	0	3267	2863	0	0	2933	1778
Otros ^c	112	20	1159	823	129	30	1853	1157	123	28	706	787
Total	132	132	7899	7882	159	159	10587	10566	151	151	7495	7439

^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.