

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 16 de septiembre de 2021<sup>1</sup>**

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\$1913 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.09%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	466,5	261,5	174,3	313,0	8,8	75,0	78,4
15-35	480,4	601,2	363,0	266,1	80,4	56,5	157,9
36-60	5,2	5,3	0,0	0,0	5,3	5,2	0,0
61-90	8,0	60,2	21,5	0,0	38,7	8,0	0,0
91-180	89,2	96,5	55,0	30,1	6,5	24,1	35,0
>180	60,3	106,3	45,0	2,4	5,3	1,9	56,0
<b>Total</b>	<b>1109,6</b>	<b>1131,0</b>	<b>658,7</b>	<b>611,6</b>	<b>145,0</b>	<b>170,7</b>	<b>327,3</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.29%	1.75%	1.86%	1.90%
15-35	2.05%	2.03%	2.03%	2.04%
36-60	—	2.30%	1.80%	2.05%
61-90	—	2.32%	2.12%	2.29%
91-180	2.37%	2.35%	2.05%	2.29%
>180	3.23%	3.80%	2.32%	3.38%
<b>Total</b>	<b>2.34%</b>	<b>2.10%</b>	<b>1.93%</b>	<b>2.09%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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 <sup>a</sup>	10	77	2691	2886	30	129	5680	6708	28	123	3891	4901
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1489	1569	0	0	3419	3045	0	0	2945	1780
Otros <sup>c</sup>	77	10	608	316	129	30	1852	1178	123	28	704	795
<b>Total</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>4788</b>	<b>4771</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>10951</b>	<b>10931</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>7540</b>	<b>7476</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.