

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 20 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\$1419 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.29%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	280,5	277,9	25,8	72,2	63,8	19,9	188,3
15-35	295,0	492,1	291,9	71,7	30,7	53,8	169,5
36-60	31,7	70,8	25,0	10,0	34,5	10,5	11,2
61-90	74,1	82,8	5,5	10,0	69,6	56,4	7,6
91-180	27,2	78,1	55,0	10,0	11,9	5,9	11,2
>180	79,4	91,8	15,0	3,8	2,8	1,6	74,0
<b>Total</b>	<b>787,8</b>	<b>1093,4</b>	<b>418,1</b>	<b>177,7</b>	<b>213,3</b>	<b>148,1</b>	<b>462,0</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	2.23%	2.07%	1.91%	2.12%
15-35	2.22%	2.24%	2.10%	2.21%
36-60	2.32%	2.34%	2.16%	2.30%
61-90	2.32%	2.45%	2.30%	2.38%
91-180	2.45%	2.50%	2.28%	2.43%
>180	3.36%	3.36%	3.42%	3.36%
<b>Total</b>	<b>2.42%</b>	<b>2.28%</b>	<b>2.12%</b>	<b>2.29%</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	20 – 24 sep.				27 sep. - 01 oct.				04 - 08 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	33	131	5981	6970	31	127	4017	5016	34	101	4773	4665
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3435	3140	0	0	2976	1811	0	0	2925	2613
Otros <sup>c</sup>	131	33	1912	1199	127	31	712	814	101	34	441	824
<b>Total</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>11328</b>	<b>11309</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>7705</b>	<b>7641</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>8139</b>	<b>8102</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.