

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 20 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\$1419 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.29%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	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
Total	787,8	1093,4	418,1	177,7	213,3	148,1	462,0

^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	2.23%		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%
Total	2.42%		2.28%	2.12%	2.29%

^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	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 ^a	33	131	5981	6970	31	127	4017	5016	34	101	4773	4665
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3435	3140	0	0	2976	1811	0	0	2925	2613
Otros ^c	131	33	1912	1199	127	31	712	814	101	34	441	824
Total	164	164	11328	11309	158	158	7705	7641	135	135	8139	8102

^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.