

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 21 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\$1766 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.32%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	320,6	307,9	165,0	114,8	18,9	81,8	124
15-35	555,8	789,6	352,3	115,6	41,3	44,2	396
36-60	37,3	85,6	50,0	0,0	15,6	17,3	20
61-90	7,7	38,9	0,0	0,0	38,9	7,7	0
91-180	46,2	95,2	50,0	0,0	5,2	6,2	40
>180	60,8	55,7	0,0	5,0	0,7	0,8	55
Total	1028,4	1372,8	617,3	235,4	120,5	158,0	635

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.39%	2.59%	1.93%	2.28%
15-35	2.13%	2.35%	2.26%	2.23%
36-60	2.38%	2.38%	2.12%	2.32%
61-90	—	2.53%	2.14%	2.46%
91-180	2.58%	2.48%	2.29%	2.51%
>180	3.30%	2.84%	3.36%	3.30%
Total	2.32%	2.44%	2.10%	2.32%

^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	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	26	113	5414	6213	44	127	4039	5025	35	101	4981	4921
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3075	2888	0	0	2976	1834	0	0	2973	2613
Otros ^c	113	26	1554	923	127	44	720	813	101	35	470	854
Total	139	139	10043	10024	171	171	7735	7672	136	136	8424	8388

^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.