

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 22 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\$1658 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.26%<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	470,4	181,6	50,9	320,9	5,7	24,5	125,0
15-35	343,2	731,4	411,7	62,1	64,2	25,6	255,5
36-60	10,7	6,7	0,0	0,0	6,7	10,7	0,0
61-90	95,1	141,3	40,0	0,0	26,2	20,0	75,1
91-180	36,9	23,5	0,0	20,0	8,5	1,9	15,0
>180	82,5	45,8	0,0	41,4	5,0	0,4	40,7
<b>Total</b>	<b>1038,9</b>	<b>1130,4</b>	<b>502,7</b>	<b>444,4</b>	<b>116,4</b>	<b>83,1</b>	<b>511,4</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	2.34%	1.35%	1.97%	1.99%
15-35	2.35%	2.32%	2.26%	2.32%
36-60	—	2.43%	1.98%	2.15%
61-90	2.29%	2.34%	2.28%	2.31%
91-180	2.44%	2.74%	2.42%	2.51%
>180	3.04%	3.12%	3.24%	3.14%
<b>Total</b>	<b>2.40%</b>	<b>2.24%</b>	<b>2.14%</b>	<b>2.26%</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>	22	103	3947	4268	46	124	4132	5084	36	101	5074	5107
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2321	2080	0	0	2983	1870	0	0	3053	2618
Otros <sup>c</sup>	103	22	828	737	124	46	722	814	101	36	512	877
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>7096</b>	<b>7085</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>7837</b>	<b>7768</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>8639</b>	<b>8602</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.