

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2021

Fecha de Información: 24 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\$1339 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.29%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	321,1	218,5	109,0	218,8	27,0	19,7	82,5
15-35	317,8	605,2	346,5	28,0	8,4	39,5	250,3
36-60	1,9	15,8	0,0	0,0	15,8	1,9	0,0
61-90	22,7	55,0	0,0	10,5	52,5	9,7	2,5
91-180	7,8	10,7	0,0	0,0	10,7	7,8	0,0
>180	90,1	86,7	0,0	0,0	8,2	11,6	78,5
Total	761,3	991,7	455,5	257,3	122,4	90,2	413,8

^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	1.90%	2.23%	1.97%	2.04%
15-35	2.34%	2.32%	2.15%	2.31%
36-60	—	2.32%	2.13%	2.30%
61-90	2.30%	2.50%	2.39%	2.46%
91-180	—	2.77%	2.41%	2.62%
>180	3.13%	3.55%	2.87%	3.13%
Total	2.40%	2.34%	2.07%	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.

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	5	39	990	1085	49	130	4344	5301	38	102	5334	5285
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	431	503	0	0	3139	2041	0	0	3148	2737
Otros ^c	39	5	235	68	130	49	755	827	102	38	522	913
Total	44	44	1656	1656	179	179	8238	8169	140	140	9004	8935

^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.