

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 27 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\$2397 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.35%<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	450,9	415,1	222,2	312,2	119,4	65,1	73,5
15-35	540,3	630,4	446,2	301,4	18,0	72,8	166,1
36-60	50,7	282,5	190,0	0,0	52,5	10,7	40,0
61-90	4,5	60,7	7,1	1,0	53,6	3,5	0,0
91-180	131,2	51,4	0,0	0,0	6,4	86,2	45,0
>180	65,2	103,1	0,0	0,0	38,6	0,7	64,5
<b>Total</b>	<b>1242,7</b>	<b>1543,3</b>	<b>865,5</b>	<b>614,6</b>	<b>288,6</b>	<b>239,0</b>	<b>389,1</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	2.37%	2.15%	1.88%	2.04%
15-35	2.38%	2.40%	2.28%	2.37%
36-60	2.44%	2.44%	2.27%	2.43%
61-90	—	2.49%	2.28%	2.48%
91-180	2.77%	2.74%	2.47%	2.58%
>180	3.59%	3.93%	3.04%	3.71%
<b>Total</b>	<b>2.63%</b>	<b>2.40%</b>	<b>2.08%</b>	<b>2.35%</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	27 sep. - 01 oct.				04 - 08 oct.				11 - 15 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	52	150	4731	5602	41	102	5407	5384	34	109	3881	4068
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3326	2342	0	0	3168	2737	0	0	2502	1705
Otros <sup>c</sup>	150	52	835	877	102	41	556	922	109	34	564	989
<b>Total</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>8892</b>	<b>8821</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>9131</b>	<b>9043</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>6947</b>	<b>6762</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.