

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 27 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\$2397 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.35%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	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
Total	1242,7	1543,3	865,5	614,6	288,6	239,0	389,1

^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	2.37%		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%
Total	2.63%		2.40%	2.08%	2.35%

^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	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 ^a	52	150	4731	5602	41	102	5407	5384	34	109	3881	4068
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3326	2342	0	0	3168	2737	0	0	2502	1705
Otros ^c	150	52	835	877	102	41	556	922	109	34	564	989
Total	202	202	8892	8821	143	143	9131	9043	143	143	6947	6762

^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.