

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de octubre de 2021
Fecha de Información: 29 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\$2960 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.53%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	568,1	536,5	101,2	345,6	269,3	56,5	166,0
15-35	590,3	655,0	309,4	326,2	182,6	101,1	163,0
36-60	354,6	43,5	0,0	80,5	41,9	272,5	1,6
61-90	22,3	268,5	181,3	7,9	74,5	1,7	12,7
91-180	6,5	27,0	15,0	0,0	12,0	6,5	0,0
>180	144,0	156,8	85,0	71,9	2,3	2,6	69,5
Total	1685,8	1687,3	691,8	832,1	582,6	440,9	412,8

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	2.52%		2.54%	1.95%	2.31%
15-35	2.55%		2.58%	2.58%	2.57%
36-60	2.32%		2.63%	2.47%	2.49%
61-90	2.48%		2.55%	2.41%	2.54%
91-180	—		2.72%	2.32%	2.64%
>180	3.46%		3.22%	2.70%	3.13%
Total	2.69%		2.61%	2.38%	2.53%

^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	41	119	3327	3763	52	107	5815	6194	42	118	4022	4295
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2333	1688	0	0	3235	2846	0	0	2543	1708
Otros ^c	119	41	542	716	107	52	1023	927	118	42	630	1000
Total	160	160	6202	6167	159	159	10073	9967	160	160	7195	7003

^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.